

Fecha de Publicación: 21 de noviembre de 2012  
 Fecha de Información: 19 de noviembre de 2012 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1388,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.<sup>2</sup>

Cuadro No. 1  
 Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	425,2	216,4	16,0	241,3	70,4	53,9	130,0
15-35	314,9	435,5	312,0	161,3	10,5	40,6	113,0
36-60	5,9	38,5	15,7	0,0	22,8	5,9	0,0
61-90	50,3	85,6	0,0	0,0	85,6	50,3	0,0
91-180	20,3	33,9	0,0	10,0	23,9	0,3	10,0
>180	10,5	9,9	0,0	5,0	4,9	0,5	5,0
<b>Total</b>	<b>827,1</b>	<b>819,7</b>	<b>343,7</b>	<b>417,6</b>	<b>218,0</b>	<b>151,6</b>	<b>258,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,6 %	4,9 %	3,2 %	3,4 %
15-35	4,1 %	4,5 %	4,5 %	4,4 %
36-60	-	5,0 %	4,4 %	4,9 %
61-90	-	4,6 %	4,3 %	4,5 %
91-180	4,2 %	4,5 %	4,5 %	4,4 %
>180	4,0 %	4,5 %	3,7 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,1 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3  
 Vencimientos de Forwards

Sectores	19 al 23 de noviembre				26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	30	96	3200	3932	40	87	2830	3150	64	85	1994	1934
Intragruppo y off-shore***	0	0	2412	1467	0	0	1769	1036	0	0	1219	1096
Otros	96	30	590	803	87	40	568	981	85	64	428	612
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>6202</b>	<b>6202</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>5167</b>	<b>5167</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>3641</b>	<b>3641</b>

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es:  $((Tasa\ Pactada/Tasa\ de\ Contado) \wedge (360/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.