

Fecha de Publicación: 4 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 30 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\$1253,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	283,2	259,0	85,5	60,5	56,5	105,7	117,0
15-35	245,2	258,2	140,0	183,9	63,2	6,2	55,0
36-60	31,2	68,0	58,0	20,0	10,0	11,2	0,0
61-90	123,5	23,6	0,0	78,0	13,6	35,5	10,0
91-180	0,1	12,3	0,0	0,0	12,3	0,1	0,0
>180	29,7	111,4	47,7	17,0	53,8	2,7	10,0
<b>Total</b>	<b>712,9</b>	<b>732,5</b>	<b>331,2</b>	<b>359,4</b>	<b>209,3</b>	<b>161,5</b>	<b>192,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,6 %	4,4 %	3,9 %	4,3 %
15-35	3,7 %	3,7 %	3,9 %	3,7 %
36-60	-	3,9 %	4,1 %	3,9 %
61-90	4,0 %	4,6 %	3,8 %	3,9 %
91-180	-	4,0 %	3,8 %	4,0 %
>180	3,7 %	3,9 %	3,7 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sector	26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	101	3738	3811	69	74	2680	2994	88	94	2481	2876
Intragruppo y off-shore***	0	0	2120	1575	0	0	1857	1270	0	0	1546	1281
Otros	101	19	585	1057	74	69	519	792	94	88	626	497
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>6443</b>	<b>6443</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>5056</b>	<b>5056</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>4653</b>	<b>4653</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.