

Fecha de Publicación: 10 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 06 de diciembre 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\$1484,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	303,0	400,9	116,0	122,5	119,9	15,5	165,0
15-35	473,8	231,5	94,0	177,5	32,5	191,3	105,0
36-60	86,8	63,6	0,0	0,0	49,6	72,8	14,0
61-90	90,9	45,5	0,0	18,6	35,5	62,3	10,0
91-180	16,1	36,5	5,0	5,0	21,5	1,1	10,0
>180	30,2	9,6	3,0	7,2	6,6	23,0	0,0
<b>Total</b>	<b>1000,8</b>	<b>787,6</b>	<b>218,0</b>	<b>330,8</b>	<b>265,6</b>	<b>366,0</b>	<b>304,0</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	3,2 %	3,7 %	2,9 %	3,3 %
15-35	2,5 %	4,3 %	3,3 %	3,2 %
36-60	3,0 %	4,0 %	3,6 %	3,7 %
61-90	3,3 %	4,5 %	4,6 %	4,5 %
91-180	2,0 %	3,4 %	3,4 %	3,1 %
>180	-	3,7 %	3,3 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,4 %</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	3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	70	63	3264	3260	72	100	3182	3502	40	132	2037	2783
Intragrupa y off-shore***	0	0	2022	1750	0	2	1755	1589	0	0	1970	1093
Otros	63	70	542	817	100	71	753	597	132	40	312	443
<b>Total</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>5827</b>	<b>5827</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>5689</b>	<b>5689</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>4319</b>	<b>4319</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.