

Fecha de Publicación: 13 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 11 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\$1499,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,8%.<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	343,4	427,9	360,2	292,3	23,2	6,6	44,5
15-35	198,7	301,2	124,0	53,4	72,2	40,3	105,0
36-60	73,7	8,3	0,0	50,0	8,3	23,7	0,0
61-90	72,8	66,8	0,0	40,0	41,8	7,8	25,0
91-180	22,0	55,2	0,0	10,0	45,2	2,0	10,0
>180	71,4	47,2	40,0	63,0	2,2	3,4	5,0
<b>Total</b>	<b>781,9</b>	<b>906,6</b>	<b>524,2</b>	<b>508,7</b>	<b>192,9</b>	<b>83,8</b>	<b>189,5</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 %	0,8 %	1,1 %	1,0 %
15-35	2,8 %	2,6 %	1,8 %	2,5 %
36-60	-	3,8 %	2,0 %	2,2 %
61-90	2,3 %	2,9 %	2,3 %	2,5 %
91-180	2,3 %	2,7 %	2,3 %	2,6 %
>180	2,8 %	1,5 %	2,5 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,8 %</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	10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	53	108	3659	4018	41	139	2356	3080	67	185	1386	1887
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	2	2109	1848	3	0	2120	1324	0	0	1107	761
<b>Otros</b>	108	52	866	768	136	41	395	467	185	67	314	160
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6634</b>	<b>6634</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>4871</b>	<b>4871</b>	<b>251</b>	<b>251</b>	<b>2808</b>	<b>2808</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.