

Fecha de Publicación: 18 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 14 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\$840,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	99,9	190,1	79,0	10,0	41,1	19,9	70,0
15-35	135,8	291,0	184,0	60,0	40,0	8,8	67,0
36-60	95,0	49,4	30,0	75,0	19,4	20,0	0,0
61-90	28,6	35,3	20,0	20,0	15,3	8,6	0,0
91-180	0,0	9,5	0,0	0,0	9,5	0,0	0,0
>180	19,5	23,1	0,6	15,7	22,5	3,8	0,0
<b>Total</b>	<b>378,7</b>	<b>598,5</b>	<b>313,6</b>	<b>180,7</b>	<b>147,9</b>	<b>61,0</b>	<b>137,0</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	1,0 %	5,6 %	0,1 %	3,5 %
15-35	3,0 %	4,5 %	3,7 %	4,1 %
36-60	-	2,3 %	3,4 %	3,0 %
61-90	-	1,8 %	1,3 %	1,5 %
91-180	-	3,3 %	-	3,3 %
>180	-	3,4 %	3,4 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>2,8 %</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**

Sector	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
Sector Financiero**	56	99	3667	4029	42	149	2510	3563	66	191	1433	2013
Intragruppo y off-shore***	0	2	2112	1855	3	0	2398	1360	0	0	1203	788
Otros	99	55	875	770	146	42	501	486	191	66	335	170
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6655</b>	<b>6655</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>5409</b>	<b>5409</b>	<b>256</b>	<b>256</b>	<b>2971</b>	<b>2971</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.