

Fecha de Publicación: 20 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 18 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\$1060,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	184,8	125,5	66,0	119,6	9,5	15,1	50,0
15-35	248,0	346,5	280,8	195,5	60,8	47,5	5,0
36-60	47,1	2,7	0,0	43,0	2,7	4,1	0,0
61-90	4,0	54,2	50,0	0,0	4,2	4,0	0,0
91-180	34,0	3,1	0,0	13,0	3,1	21,0	0,0
>180	25,0	40,6	0,0	20,0	40,6	5,0	0,0
<b>Total</b>	<b>543,0</b>	<b>572,6</b>	<b>396,8</b>	<b>391,1</b>	<b>120,9</b>	<b>96,8</b>	<b>55,0</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	4,3 %	4,8 %	3,8 %	4,2 %
15-35	3,3 %	4,0 %	2,9 %	3,6 %
36-60	-	4,3 %	3,6 %	3,6 %
61-90	-	3,2 %	3,6 %	3,3 %
91-180	-	4,2 %	3,3 %	3,4 %
>180	-	3,4 %	3,5 %	3,4 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,7 %</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	17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	152	2775	3707	66	181	1545	2087	2	23	1099	1501
Intragruppo y off-shore***	3	0	2509	1604	0	0	1240	863	0	0	1045	546
Otros	149	43	510	482	181	66	346	182	23	2	221	318
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>5794</b>	<b>5794</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>3132</b>	<b>3132</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>2365</b>	<b>2365</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.