

Fecha de Publicación: 09 de Octubre de 2012  
 Fecha de Información: 05 de Octubre 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\$1356,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	316,6	319,9	177,5	150,5	12,4	36,1	130,0
15-35	293,8	488,0	348,9	123,5	74,9	106,1	64,2
36-60	10,3	4,7	0,0	0,0	4,7	10,3	0,0
61-90	13,5	28,3	10,0	0,0	8,3	3,5	10,0
91-180	30,7	37,2	0,0	0,0	27,2	20,7	10,0
>180	0,7	27,0	25,0	0,0	2,0	0,7	0,0
<b>Total</b>	<b>665,6</b>	<b>905,1</b>	<b>561,4</b>	<b>274,0</b>	<b>129,5</b>	<b>177,4</b>	<b>214,2</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	6,4 %	3,1 %	2,9 %	3,9 %
15-35	5,6 %	5,3 %	4,6 %	5,1 %
36-60	-	6,1 %	5,0 %	5,3 %
61-90	5,4 %	5,4 %	4,8 %	5,3 %
91-180	5,0 %	4,9 %	4,7 %	4,8 %
>180	-	4,2 %	4,2 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,6 %</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	1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre				15 al 19 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	141	43	3168	3536	65	47	2688	3254	11	75	1784	2376
Intragrupa y off-shore***	0	0	2465	1442	0	1	2023	1209	0	0	1438	518
Otros	43	141	286	941	47	64	430	679	75	11	402	729
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>5919</b>	<b>5919</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>5142</b>	<b>5142</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>3624</b>	<b>3624</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.