

Fecha de Publicación: 13 de noviembre de 2012  
 Fecha de Información: 08 de noviembre 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\$2193,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	321,0	323,6	179,0	181,0	37,6	32,9	107,1
15-35	438,1	691,8	566,8	219,3	58,1	151,8	67,0
36-60	60,7	8,0	0,0	0,0	8,0	60,7	0,0
61-90	82,8	104,0	45,0	0,0	59,0	82,8	0,0
91-180	17,6	16,3	0,0	15,0	16,2	2,5	0,1
>180	161,5	163,5	25,0	140,0	117,3	0,3	21,2
<b>Total</b>	<b>1081,7</b>	<b>1307,2</b>	<b>815,8</b>	<b>555,3</b>	<b>296,2</b>	<b>331,1</b>	<b>195,3</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	3,4 %	4,1 %	3,9 %	3,8 %
15-35	2,9 %	3,5 %	3,5 %	3,5 %
36-60	-	4,6 %	4,5 %	4,5 %
61-90	-	2,1 %	1,6 %	1,8 %
91-180	4,1 %	4,1 %	4,1 %	4,1 %
>180	3,6 %	4,0 %	3,5 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,5 %</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	5 al 9 de noviembre				12 al 16 de noviembre				19 al 23 de noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	103	72	3297	3419	46	166	2453	3150	30	87	2524	3341
Intragruppo y off-shore***	0	0	1736	1222	0	1	1935	1150	0	0	2170	1108
Otros	71	103	517	910	166	45	467	554	87	30	489	734
<b>Total</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>5550</b>	<b>5550</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>4855</b>	<b>4855</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>5183</b>	<b>5183</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 intragruppo.