

Fecha de Publicación: 30 de noviembre de 2012  
 Fecha de Información: 28 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\$1570,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	358,2	246,2	64,2	152,8	2,3	25,7	179,7
15-35	314,3	349,3	274,3	246,0	11,0	4,3	64,0
36-60	77,0	5,2	4,0	1,4	1,2	75,6	0,0
61-90	107,1	237,1	165,0	0,0	67,1	102,1	5,0
91-180	0,5	6,4	0,0	0,0	6,4	0,5	0,0
>180	57,0	65,7	47,0	38,5	13,7	13,5	5,0
<b>Total</b>	<b>914,1</b>	<b>910,0</b>	<b>554,5</b>	<b>438,7</b>	<b>101,8</b>	<b>221,7</b>	<b>253,7</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	4,1 %	4,7 %	1,7 %	3,2 %
15-35	4,4 %	4,7 %	1,2 %	3,3 %
36-60	-	5,3 %	4,4 %	4,4 %
61-90	3,8 %	2,8 %	4,3 %	3,3 %
91-180	-	4,3 %	3,5 %	4,3 %
>180	3,8 %	4,5 %	3,6 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>2,4 %</b>	<b>3,3 %</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	26 al 30 de noviembre				3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	97	3722	3813	65	72	2441	2758	87	91	2293	2762
Intragrupa y off-shore***	0	0	2119	1560	0	0	1749	1225	0	0	1511	1192
Otros	97	20	588	1055	71	65	477	685	91	87	592	443
<b>Total</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>6428</b>	<b>6428</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>4668</b>	<b>4668</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>4396</b>	<b>4396</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 intragrupo.