

Fecha de Publicación: 06 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 04 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\$1246,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupoy y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	333,8	216,6	112,0	143,3	14,6	100,5	90,0
15-35	167,9	274,7	222,5	112,3	15,2	18,7	37,0
36-60	56,1	31,8	4,6	15,0	7,2	21,1	20,0
61-90	166,4	94,0	20,7	40,0	63,3	116,4	10,0
91-180	0,6	9,9	0,0	0,0	9,9	0,6	0,0
>180	19,5	32,2	5,0	15,0	27,2	4,5	0,0
<b>Total</b>	<b>744,4</b>	<b>659,1</b>	<b>364,7</b>	<b>325,5</b>	<b>137,4</b>	<b>261,9</b>	<b>157,0</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	3,3 %	3,7 %	2,4 %	2,9 %
15-35	1,9 %	3,7 %	3,9 %	3,6 %
36-60	4,0 %	4,5 %	3,6 %	3,9 %
61-90	3,6 %	3,7 %	3,6 %	3,6 %
91-180	-	4,0 %	3,2 %	4,0 %
>180	-	3,9 %	3,5 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,2 %</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**

Sectores	3 al 7 de diciembre				10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	70	68	2833	3139	70	97	2799	3046	40	126	1896	2594
<b>Intragrupoy off-shore***</b>	0	0	1970	1380	0	2	1596	1386	0	0	1863	1043
<b>Otros</b>	67	70	535	818	97	68	631	595	126	40	308	430
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5338</b>	<b>5338</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>5027</b>	<b>5027</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>4067</b>	<b>4067</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.