

Fecha de Publicación: 12 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 10 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\$1505,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<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	178,0	280,6	134,0	85,5	80,7	26,5	66,0
15-35	319,5	595,7	339,8	117,8	54,4	0,3	201,5
36-60	127,5	131,8	50,0	40,0	11,8	17,5	70,0
61-90	71,0	29,9	5,1	45,0	4,9	6,0	20,0
91-180	40,4	9,9	0,0	40,0	9,9	0,4	0,0
>180	73,0	18,4	0,0	60,0	5,4	0,0	13,0
<b>Total</b>	<b>809,5</b>	<b>1066,4</b>	<b>528,8</b>	<b>388,2</b>	<b>167,1</b>	<b>50,8</b>	<b>370,5</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	0,0 %	1,3 %	-0,6 %	0,5 %
15-35	0,3 %	0,8 %	-0,3 %	0,5 %
36-60	0,7 %	0,3 %	0,6 %	0,6 %
61-90	1,5 %	1,8 %	1,3 %	1,5 %
91-180	-	2,4 %	2,4 %	2,4 %
>180	2,7 %	3,6 %	2,7 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,8 %</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	10 al 14 de diciembre				17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	106	3508	3734	41	140	2169	2959	67	185	1333	1804
Intragrupa y off-shore***	0	2	1836	1727	3	0	2033	1153	0	0	1107	761
Otros	106	51	865	748	137	41	377	467	185	67	284	159
<b>Total</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>6210</b>	<b>6210</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>4579</b>	<b>4579</b>	<b>251</b>	<b>251</b>	<b>2725</b>	<b>2725</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.