

Fecha de Publicación: 24 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 20 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\$1192,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	205,7	156,5	146,6	193,1	9,9	12,6	0,0
15-35	302,3	468,2	321,8	110,0	40,4	86,3	106,0
36-60	6,5	10,1	0,0	0,0	10,1	6,5	0,0
61-90	43,5	44,4	40,8	0,0	3,6	43,5	0,0
91-180	5,4	17,8	10,0	0,0	7,8	5,4	0,0
>180	21,7	36,8	0,0	0,0	16,8	1,7	20,0
<b>Total</b>	<b>585,1</b>	<b>733,8</b>	<b>519,2</b>	<b>303,1</b>	<b>88,6</b>	<b>156,0</b>	<b>126,0</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	-	4,5 %	5,2 %	4,9 %
15-35	2,8 %	3,8 %	3,5 %	3,5 %
36-60	-	4,8 %	3,1 %	4,1 %
61-90	-	3,9 %	3,5 %	3,7 %
91-180	-	3,9 %	3,3 %	3,8 %
>180	3,4 %	4,2 %	3,2 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>2,9 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>3,9 %</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	17 al 21 de diciembre				24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	161	3128	3772	91	183	1653	2230	2	23	1153	1620
Intragrupa y off-shore***	3	0	2521	1902	0	0	1378	963	0	0	1129	564
Otros	158	43	509	483	183	91	352	190	23	2	228	324
<b>Total</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>6157</b>	<b>6157</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>3383</b>	<b>3383</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>2509</b>	<b>2509</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.