

Fecha de Publicación: 27 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 24 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\$192,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	63,1	57,9	0,0	0,0	0,9	6,1	57,0
15-35	50,3	80,6	63,2	3,3	3,4	33,0	14,0
36-60	0,0	1,5	0,0	0,0	1,5	0,0	0,0
61-90	0,0	1,3	0,0	0,0	1,3	0,0	0,0
91-180	1,4	3,7	0,0	0,0	2,7	0,4	1,0
>180	0,3	4,2	0,0	0,0	4,2	0,3	0,0
<b>Total</b>	<b>115,0</b>	<b>149,2</b>	<b>63,2</b>	<b>3,3</b>	<b>14,0</b>	<b>39,7</b>	<b>72,0</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	1,4 %	11,0 %	3,6 %	1,8 %
15-35	3,0 %	3,4 %	3,0 %	3,3 %
36-60	-	5,6 %	-	5,6 %
61-90	-	4,5 %	-	4,5 %
91-180	3,7 %	4,9 %	3,0 %	4,5 %
>180	-	3,9 %	3,6 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>1,8 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,8 %</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	24 al 28 de diciembre				31 de dic. al 4 de enero				7 al 11 de enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	182	1725	2344	2	24	1182	1679	4	35	2372	2534
Intragrupa y off-shore***	0	0	1400	985	0	0	1149	564	0	0	1460	1047
Otros	182	72	400	196	24	2	239	326	35	4	372	624
<b>Total</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>3525</b>	<b>3525</b>	<b>27</b>	<b>27</b>	<b>2569</b>	<b>2569</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>4204</b>	<b>4204</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.