

Fecha de Publicación: 21 de diciembre de 2012  
 Fecha de Información: 19 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\$1293,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	299,1	136,0	72,0	211,0	10,0	34,1	54,0
15-35	252,3	437,1	319,7	111,5	63,4	86,8	54,0
36-60	56,6	67,6	22,0	10,0	10,6	11,6	35,0
61-90	76,6	7,7	0,0	45,0	7,7	31,6	0,0
91-180	10,7	5,2	0,0	0,0	5,2	10,7	0,0
>180	31,2	85,9	20,7	0,0	35,2	1,2	30,0
<b>Total</b>	<b>726,6</b>	<b>739,5</b>	<b>434,4</b>	<b>377,5</b>	<b>132,1</b>	<b>176,1</b>	<b>173,0</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	1,6 %	4,5 %	3,2 %	3,2 %
15-35	3,4 %	3,7 %	2,7 %	3,4 %
36-60	3,8 %	4,3 %	3,6 %	3,8 %
61-90	-	4,6 %	3,5 %	3,6 %
91-180	-	4,4 %	3,4 %	3,7 %
>180	3,6 %	3,6 %	3,1 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>3,1 %</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	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	152	2970	3780	90	182	1607	2126	2	23	1122	1524
Intragrupa y off-shore***	3	0	2521	1747	0	0	1278	925	0	0	1067	564
Otros	149	43	516	479	182	90	348	182	23	2	222	322
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>6007</b>	<b>6007</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>3233</b>	<b>3233</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>2411</b>	<b>2411</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.