

Fecha de Publicación: 05 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 03 de Septiembre 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\$97,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,6	33,8	0,0	13,0	3,8	10,5	30,0
15-35	23,3	2,1	0,0	9,0	2,1	14,3	0,0
36-60	0,7	0,1	0,0	0,0	0,1	0,7	0,0
61-90	3,9	3,8	0,0	0,0	3,8	3,9	0,0
91-180	0,0	5,6	0,0	0,0	5,6	0,0	0,0
>180	0,0	0,6	0,0	0,0	0,6	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>81,5</b>	<b>45,9</b>	<b>0,0</b>	<b>22,0</b>	<b>15,9</b>	<b>29,4</b>	<b>30,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,8 %	5,5 %	4,9 %	5,4 %
15-35	-	7,8 %	4,5 %	4,8 %
36-60	-	10,5 %	4,2 %	5,3 %
61-90	-	6,0 %	4,6 %	5,3 %
91-180	-	5,1 %	-	5,1 %
>180	-	4,6 %	-	4,6 %
<b>Total</b>	<b>5,8 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,2 %</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**

Sector	3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	170	71	2631	2968	49	72	2327	2903	64	65	2403	2987
Intragruppo y off-shore***	0	0	2014	1041	0	1	1790	884	0	0	2232	836
Otros	71	170	396	1032	72	48	566	896	65	64	286	1097
<b>Total</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>5041</b>	<b>5041</b>	<b>121</b>	<b>121</b>	<b>4683</b>	<b>4683</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4921</b>	<b>4921</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 intragruppo.