

Fecha de Publicación: 06 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 04 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\$962,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	157,5	143,5	71,0	49,4	12,5	48,1	60,0
15-35	306,0	334,4	229,5	49,0	53,9	206,0	51,0
36-60	12,4	30,7	29,0	10,0	1,7	2,4	0,0
61-90	36,4	4,2	0,0	0,0	4,2	36,4	0,0
91-180	0,7	16,3	0,0	0,0	16,3	0,7	0,0
>180	11,1	20,2	7,0	0,0	13,2	11,1	0,0
<b>Total</b>	<b>524,1</b>	<b>549,2</b>	<b>336,5</b>	<b>108,4</b>	<b>101,7</b>	<b>304,7</b>	<b>111,0</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	5,2 %	5,5 %	3,9 %	4,8 %
15-35	5,1 %	6,3 %	5,9 %	6,0 %
36-60	-	6,2 %	6,1 %	6,2 %
61-90	-	5,9 %	5,7 %	5,7 %
91-180	-	4,8 %	4,0 %	4,8 %
>180	-	4,4 %	4,1 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>5,6 %</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**	176	66	2618	3005	53	72	2406	3021	65	65	2419	2982
Intragrupo y off-shore***	0	0	2020	1080	0	1	1852	894	0	0	2235	836
Otros	66	176	414	967	72	51	575	918	65	65	278	1113
<b>Total</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>5053</b>	<b>5053</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4833</b>	<b>4833</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4932</b>	<b>4932</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.