

Fecha de Publicación: 07 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 05 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\$1739,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<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	409,0	83,5	12,5	337,7	70,7	71,0	0,3
15-35	529,2	582,7	355,0	315,0	124,7	111,2	103,0
36-60	11,4	26,1	0,0	0,0	16,1	1,4	10,0
61-90	34,2	59,3	0,0	0,7	59,3	33,5	0,0
91-180	1,2	20,5	0,0	0,0	20,5	1,2	0,0
>180	5,0	95,3	50,0	0,0	40,3	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>990,0</b>	<b>867,5</b>	<b>417,5</b>	<b>653,4</b>	<b>331,7</b>	<b>218,2</b>	<b>118,4</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	5,9 %	6,9 %	3,3 %	4,0 %
15-35	4,6 %	6,3 %	6,1 %	6,0 %
36-60	6,1 %	6,5 %	5,6 %	6,3 %
61-90	-	5,8 %	5,2 %	5,6 %
91-180	-	5,0 %	4,8 %	5,0 %
>180	3,8 %	4,1 %	-	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>5,3 %</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	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	63	2873	3003	53	72	2536	3049	65	72	2467	2999
Intragruppo y off-shore***	0	0	2020	1354	0	1	1854	959	0	0	2245	881
Otros	63	176	412	948	72	51	600	983	72	65	285	1116
<b>Total</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>5305</b>	<b>5305</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4991</b>	<b>4991</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>4996</b>	<b>4996</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.