

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 10 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\$1135,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.<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	251,8	215,6	40,0	125,3	70,6	21,5	105,0
15-35	396,7	240,2	162,5	244,5	5,7	80,2	72,0
36-60	59,7	55,0	0,8	0,0	54,1	59,7	0,0
61-90	0,5	1,1	0,0	0,0	1,1	0,5	0,0
91-180	20,3	60,1	13,0	0,0	27,1	0,3	20,0
>180	10,9	20,9	10,0	10,0	10,9	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>740,0</b>	<b>592,8</b>	<b>226,3</b>	<b>379,8</b>	<b>169,5</b>	<b>163,2</b>	<b>197,0</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	5,2 %	5,2 %	3,2 %	4,5 %
15-35	5,0 %	5,1 %	4,7 %	4,8 %
36-60	-	5,3 %	5,2 %	5,3 %
61-90	-	5,3 %	3,7 %	4,8 %
91-180	4,4 %	3,8 %	4,4 %	4,0 %
>180	-	4,2 %	2,2 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,7 %</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	10 al 14 de Septiembre				17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	56	72	3040	3528	69	79	2751	3288	78	91	2554	2854
Intragruppo y off-shore***	0	1	1932	1144	5	0	2377	1057	0	0	1936	932
Otros	72	55	775	1076	74	69	368	1151	91	78	452	1156
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5747</b>	<b>5747</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>5496</b>	<b>5496</b>	<b>169</b>	<b>169</b>	<b>4942</b>	<b>4942</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.