

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 11 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\$1265,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	388,9	151,5	19,0	269,5	47,1	34,0	85,4
15-35	272,3	362,1	265,5	171,3	20,6	25,0	76,0
36-60	68,9	52,5	25,0	15,0	27,5	53,9	0,0
61-90	0,0	11,4	0,0	0,0	11,4	0,0	0,0
91-180	26,1	65,4	5,0	0,0	40,4	6,1	20,0
>180	21,8	39,2	15,0	5,0	11,2	3,8	13,0
<b>Total</b>	<b>778,2</b>	<b>682,0</b>	<b>329,5</b>	<b>460,8</b>	<b>158,1</b>	<b>123,0</b>	<b>194,4</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,8 %	5,2 %	2,2 %	2,9 %
15-35	4,6 %	4,7 %	4,2 %	4,5 %
36-60	-	4,8 %	4,6 %	4,7 %
61-90	-	5,0 %	2,2 %	5,0 %
91-180	4,2 %	4,5 %	4,3 %	4,4 %
>180	3,4 %	3,5 %	3,5 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,9 %</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	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**	55	69	3331	3592	71	79	2841	3371	78	92	2573	2905
Intragrupa y off-shore***	0	1	1941	1399	5	0	2387	1061	0	0	1974	937
Otros	69	54	815	1096	74	71	371	1167	92	78	465	1170
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>6087</b>	<b>6087</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>5599</b>	<b>5599</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>5012</b>	<b>5012</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.