

Fecha de Publicación: 20 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 18 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\$969,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.<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	243,7	135,9	45,0	63,0	26,9	116,7	64,0
15-35	303,3	327,5	127,0	102,0	43,5	44,3	157,0
36-60	49,9	30,6	0,0	0,0	30,6	49,9	0,0
61-90	0,0	7,2	0,0	0,0	7,2	0,0	0,0
91-180	52,1	13,5	0,0	10,0	13,5	42,1	0,0
>180	16,9	19,9	0,0	5,0	9,9	1,9	10,0
<b>Total</b>	<b>665,9</b>	<b>534,6</b>	<b>172,0</b>	<b>180,0</b>	<b>131,6</b>	<b>254,9</b>	<b>231,0</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	3,1 %	2,8 %	4,9 %	4,1 %
15-35	4,3 %	4,5 %	3,1 %	4,0 %
36-60	-	4,5 %	4,4 %	4,4 %
61-90	-	4,8 %	3,9 %	4,8 %
91-180	-	4,3 %	4,1 %	4,1 %
>180	3,5 %	4,0 %	3,2 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>4,1 %</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	17 al 21 de Septiembre				24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	73	83	3748	4009	74	90	2923	3312	122	38	1916	2381
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	5	0	2766	1633	0	0	2190	1060	0	0	1734	768
<b>Otros</b>	78	73	436	1308	90	74	556	1297	38	122	239	740
<b>Total</b>	<b>156</b>	<b>156</b>	<b>6950</b>	<b>6950</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>5670</b>	<b>5670</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>3889</b>	<b>3889</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.