

**Fecha de Publicación: 01 de Octubre de 2012**  
**Fecha de Información: 27 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\$1467,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	274,6	312,3	248,4	208,6	40,9	43,0	23,0
15-35	158,4	378,6	278,2	13,0	10,4	55,4	90,0
36-60	54,3	6,2	0,0	0,0	6,2	54,3	0,0
61-90	91,0	233,1	0,0	0,0	198,1	56,0	35,0
91-180	83,7	16,5	0,0	15,0	16,5	68,7	0,0
>180	1,5	5,3	0,0	0,0	5,3	1,5	0,0
<b>Total</b>	<b>663,6</b>	<b>952,0</b>	<b>526,6</b>	<b>236,6</b>	<b>277,4</b>	<b>279,0</b>	<b>148,0</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	5,1 %	4,6 %	3,2 %	4,0 %
15-35	2,7 %	3,8 %	4,4 %	3,7 %
36-60	-	5,5 %	4,7 %	4,8 %
61-90	4,7 %	5,1 %	4,8 %	5,0 %
91-180	-	5,3 %	4,4 %	4,6 %
>180	-	4,3 %	3,9 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,2 %</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	24 al 28 de Septiembre				1 al 5 de Octubre				8 al 12 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	74	87	3924	3995	123	39	2483	3138	40	47	1818	2425
Intragrupa y off-shore***	0	0	2470	1609	0	0	2350	1066	0	0	1584	819
Otros	87	74	680	1470	39	123	267	895	47	40	375	533
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>7074</b>	<b>7074</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5100</b>	<b>5100</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>3777</b>	<b>3777</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.