

Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2012  
 Fecha de Información: 26 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\$1115,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	148,3	104,2	37,0	22,0	7,2	66,3	60,0
15-35	358,5	407,2	290,0	63,0	32,2	210,5	85,0
36-60	1,7	13,7	0,0	0,0	13,7	1,7	0,0
61-90	3,8	71,4	30,0	0,0	39,4	1,8	2,0
91-180	82,6	34,0	0,0	18,0	19,0	49,6	15,0
>180	23,1	49,4	25,0	0,0	4,4	3,1	20,0
<b>Total</b>	<b>618,0</b>	<b>679,9</b>	<b>382,0</b>	<b>103,0</b>	<b>115,9</b>	<b>333,0</b>	<b>182,0</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	1,7 %	6,3 %	4,0 %	3,4 %
15-35	4,1 %	5,1 %	4,3 %	4,6 %
36-60	-	6,5 %	3,8 %	6,2 %
61-90	4,6 %	3,8 %	3,6 %	3,8 %
91-180	5,0 %	4,8 %	4,0 %	4,3 %
>180	3,7 %	3,8 %	3,4 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,3 %</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	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	3917	3995	123	40	2278	2968	38	47	1753	2262
Intragrupa y off-shore***	0	0	2470	1609	0	0	2204	916	0	0	1461	760
Otros	87	74	679	1463	40	123	265	863	47	38	334	526
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>7066</b>	<b>7066</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>4747</b>	<b>4747</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>3549</b>	<b>3549</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.