

Fecha de Publicación: 29 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 27 de Agosto 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\$1223,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	349,4	193,7	76,0	213,5	17,7	35,9	100,0
15-35	317,1	400,3	314,5	87,0	4,7	149,0	81,1
36-60	23,2	11,8	10,0	0,0	1,8	23,2	0,0
61-90	2,7	1,7	0,0	0,0	1,7	2,7	0,0
91-180	40,4	20,3	0,0	29,0	20,3	11,4	0,0
>180	17,7	26,0	20,0	0,0	6,0	17,7	0,0
<b>Total</b>	<b>750,4</b>	<b>653,7</b>	<b>420,5</b>	<b>329,5</b>	<b>52,1</b>	<b>239,8</b>	<b>181,1</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	6,0 %	5,1 %	3,9 %	4,9 %
15-35	3,5 %	6,0 %	5,6 %	5,4 %
36-60	-	5,6 %	5,0 %	5,2 %
61-90	-	5,5 %	6,0 %	5,8 %
91-180	-	5,4 %	4,5 %	4,9 %
>180	-	3,7 %	3,9 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,1 %</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**

Sectores	27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre				10 al 14 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	94	3172	3410	164	76	2324	2753	40	71	2132	2520
Intragruppo y off-shore***	0	0	2058	1118	0	0	1934	916	0	0	1572	853
Otros	94	34	419	1122	76	164	315	904	71	40	532	862
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5649</b>	<b>5649</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>4573</b>	<b>4573</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4235</b>	<b>4235</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.