

Fecha de Publicación: 10 de Julio de 2012  
 Fecha de Información: 06 de Julio 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\$1440,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.<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	332,3	197,9	32,9	153,5	66,0	79,7	99,0
15-35	459,5	622,1	441,7	162,4	16,0	132,6	164,5
36-60	4,4	54,4	0,0	0,0	54,4	4,4	0,0
61-90	13,2	2,4	0,0	0,0	2,4	13,2	0,0
91-180	0,2	6,6	2,5	0,0	4,1	0,2	0,0
>180	2,3	8,9	0,0	0,0	8,9	2,3	0,0
<b>Total</b>	<b>811,8</b>	<b>892,3</b>	<b>477,1</b>	<b>315,9</b>	<b>151,8</b>	<b>232,4</b>	<b>263,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operacines 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	6,1 %	7,7 %	4,0 %	5,4 %
15-35	4,1 %	5,7 %	5,7 %	5,4 %
36-60	-	7,8 %	6,6 %	7,7 %
61-90	-	7,8 %	5,8 %	6,1 %
91-180	-	6,7 %	5,0 %	6,6 %
>180	-	5,3 %	4,5 %	5,1 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,5 %</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	2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	94	60	2100	2096	62	98	3028	3217	189	85	2480	3185
Intragruppo y off-shore***	0	0	1223	736	10	0	2106	1164	0	2	2283	967
Otros	60	94	300	790	87	62	400	1154	85	187	303	914
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>3622</b>	<b>3622</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>5534</b>	<b>5534</b>	<b>274</b>	<b>274</b>	<b>5066</b>	<b>5066</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.