

Fecha de Publicación: 11 de Julio de 2012  
 Fecha de Información: 09 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\$981,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,5%.<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	250,9	189,8	82,4	126,4	20,4	37,5	87,0
15-35	285,9	268,5	127,1	129,0	68,4	83,9	73,0
36-60	36,8	30,2	30,0	0,0	0,2	36,8	0,0
61-90	6,5	0,4	0,0	0,0	0,4	6,5	0,0
91-180	31,5	1,6	0,0	0,0	1,6	31,5	0,0
>180	25,3	16,8	10,0	18,5	3,8	3,8	3,0
<b>Total</b>	<b>636,9</b>	<b>507,3</b>	<b>249,4</b>	<b>273,9</b>	<b>94,9</b>	<b>200,0</b>	<b>163,0</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	4,9 %	7,3 %	5,6 %	5,7 %
15-35	7,0 %	7,1 %	7,2 %	7,1 %
36-60	-	6,6 %	6,8 %	6,7 %
61-90	-	6,8 %	6,2 %	6,2 %
91-180	-	5,5 %	5,3 %	5,3 %
>180	4,0 %	4,0 %	3,8 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>5,8 %</b>	<b>6,9 %</b>	<b>6,4 %</b>	<b>6,5 %</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	9 al 13 de Julio				16 al 20 de Julio				23 al 27 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	62	103	3206	3310	190	87	2542	3291	154	67	2399	2706
Intragrupa y off-shore***	10	0	2168	1319	0	2	2337	971	0	0	2008	942
Otros	93	62	410	1155	87	189	304	921	67	154	346	1106
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>5784</b>	<b>5784</b>	<b>277</b>	<b>277</b>	<b>5183</b>	<b>5183</b>	<b>221</b>	<b>221</b>	<b>4754</b>	<b>4754</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.