

Fecha de Publicación: 3 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 01 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\$1171,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.<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	419,5	159,4	6,3	264,3	19,1	21,2	134,0
15-35	317,0	431,4	249,8	125,0	53,6	64,0	128,0
36-60	1,8	3,2	0,0	0,0	3,2	1,8	0,0
61-90	12,2	24,0	0,0	0,0	19,0	7,2	5,0
91-180	23,8	37,0	0,0	0,0	17,0	3,8	20,0
>180	17,0	12,5	0,0	15,0	12,5	2,0	0,0
<b>Total</b>	<b>791,4</b>	<b>667,5</b>	<b>256,1</b>	<b>404,3</b>	<b>124,5</b>	<b>100,1</b>	<b>287,0</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	4,8 %	7,3 %	6,0 %	5,6 %
15-35	6,6 %	6,8 %	6,4 %	6,6 %
36-60	-	7,7 %	5,5 %	6,9 %
61-90	6,0 %	6,1 %	5,5 %	5,9 %
91-180	5,7 %	5,6 %	5,1 %	5,6 %
>180	-	4,9 %	5,0 %	5,0 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>6,6 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,2 %</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	30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	155	80	3143	3543	168	58	2637	2926	227	65	1707	2724
Intragrupa y off-shore***	0	0	2179	1230	0	0	1689	965	0	0	1865	464
Otros	79	155	394	943	58	168	394	830	65	227	294	679
<b>Total</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>5716</b>	<b>5716</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>4720</b>	<b>4720</b>	<b>292</b>	<b>292</b>	<b>3866</b>	<b>3866</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.