

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 09 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\$1322,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.<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	291,0	221,0	49,0	138,5	38,0	18,5	134,0
15-35	400,3	463,8	316,5	156,5	31,3	127,8	116,0
36-60	54,5	3,6	0,0	0,0	3,6	54,5	0,0
61-90	3,2	19,6	0,0	0,0	19,6	3,2	0,0
91-180	45,3	32,8	10,0	45,0	22,8	0,3	0,0
>180	10,4	36,9	25,0	0,0	1,9	0,4	10,0
<b>Total</b>	<b>804,6</b>	<b>777,6</b>	<b>400,5</b>	<b>340,0</b>	<b>117,1</b>	<b>204,6</b>	<b>260,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,2 %	4,6 %	4,9 %	4,2 %
15-35	5,5 %	6,1 %	6,3 %	6,1 %
36-60	-	6,7 %	5,9 %	5,9 %
61-90	-	6,7 %	5,3 %	6,5 %
91-180	-	4,7 %	4,3 %	4,5 %
>180	4,3 %	4,6 %	2,4 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>5,7 %</b>	<b>5,7 %</b>	<b>5,4 %</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	6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	170	58	3220	3174	240	81	2157	3093	142	67	2302	2432
Intragruppo y off-shore***	0	2	1879	1435	6	0	1967	610	0	0	1619	530
Otros	58	168	396	885	74	240	400	821	67	142	344	1302
<b>Total</b>	<b>228</b>	<b>228</b>	<b>5494</b>	<b>5494</b>	<b>320</b>	<b>320</b>	<b>4524</b>	<b>4524</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>4264</b>	<b>4264</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.