

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 10 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\$1068,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	244,2	202,7	135,0	131,0	8,5	54,0	59,2
15-35	204,8	227,6	189,0	98,1	13,6	81,7	25,0
36-60	26,3	23,6	20,0	20,0	3,6	6,3	0,0
61-90	118,3	17,8	0,0	60,0	12,8	53,3	5,0
91-180	5,5	28,1	10,0	0,0	13,1	0,5	5,0
>180	5,1	58,8	0,0	5,0	58,8	0,1	0,0
<b>Total</b>	<b>604,3</b>	<b>558,7</b>	<b>354,0</b>	<b>314,1</b>	<b>110,5</b>	<b>196,0</b>	<b>94,2</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	6,7 %	3,5 %	4,0 %	4,3 %
15-35	6,2 %	6,4 %	5,7 %	6,0 %
36-60	-	5,9 %	5,2 %	5,5 %
61-90	5,9 %	5,9 %	4,9 %	5,1 %
91-180	5,0 %	5,6 %	5,0 %	5,5 %
>180	-	4,3 %	3,9 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>6,4 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,0 %</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**	168	57	3218	3173	239	81	2384	3208	142	67	2322	2517
Intragrupa y off-shore***	0	2	1879	1435	6	0	2022	741	0	0	1699	530
Otros	57	166	395	883	75	239	403	860	67	142	346	1320
<b>Total</b>	<b>225</b>	<b>225</b>	<b>5491</b>	<b>5491</b>	<b>320</b>	<b>320</b>	<b>4809</b>	<b>4809</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>4367</b>	<b>4367</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.