

Fecha de Publicación: 21 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 16 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\$1625,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	233,3	395,3	288,1	71,2	27,2	82,1	80,0
15-35	334,5	461,8	409,0	155,0	7,3	134,0	45,5
36-60	77,8	71,3	14,8	0,0	1,5	22,8	55,0
61-90	9,5	41,7	10,0	0,4	31,7	9,2	0,0
91-180	54,1	23,3	20,0	20,0	3,3	34,1	0,0
>180	27,4	76,2	66,0	0,0	10,2	27,4	0,0
<b>Total</b>	<b>736,6</b>	<b>1069,6</b>	<b>807,9</b>	<b>246,6</b>	<b>81,2</b>	<b>309,6</b>	<b>180,5</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	3,9 %	5,8 %	3,4 %	4,7 %
15-35	6,1 %	5,5 %	5,6 %	5,6 %
36-60	5,5 %	5,3 %	4,5 %	5,2 %
61-90	-	3,8 %	4,2 %	3,9 %
91-180	-	4,9 %	4,3 %	4,5 %
>180	-	3,9 %	3,3 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,1 %</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	13 al 17 de Agosto				20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	241	77	3013	3513	152	79	2818	3356	30	111	2027	2576
Intragruppo y off-shore***	6	0	2133	1161	0	0	2096	550	0	0	1771	557
Otros	71	241	447	918	79	152	464	1472	111	30	314	979
<b>Total</b>	<b>318</b>	<b>318</b>	<b>5592</b>	<b>5592</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>5378</b>	<b>5378</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>4112</b>	<b>4112</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.