

Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 17 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\$1398,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	288,8	178,7	50,0	100,0	5,7	65,8	123,0
15-35	482,9	428,6	348,0	252,8	16,6	166,2	64,0
36-60	66,2	1,5	0,0	60,0	1,5	6,2	0,0
61-90	1,6	8,9	0,0	0,0	8,9	1,6	0,0
91-180	5,1	52,0	45,0	0,0	6,9	5,0	0,1
>180	19,4	69,9	50,0	0,0	2,3	1,8	17,6
<b>Total</b>	<b>864,0</b>	<b>739,6</b>	<b>493,0</b>	<b>412,8</b>	<b>41,9</b>	<b>246,5</b>	<b>204,7</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	4,2 %	3,8 %	2,1 %	3,2 %
15-35	6,3 %	5,0 %	4,4 %	4,8 %
36-60	-	7,6 %	5,1 %	5,1 %
61-90	-	5,1 %	3,9 %	4,9 %
91-180	4,4 %	4,9 %	3,8 %	4,7 %
>180	3,6 %	3,8 %	3,2 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,3 %</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	78	3013	3514	152	79	3011	3476	30	113	2120	2639
Intragrupa y off-shore***	6	0	2133	1161	0	0	2146	640	0	0	1771	567
Otros	71	241	448	918	79	152	474	1515	113	30	315	1000
<b>Total</b>	<b>319</b>	<b>319</b>	<b>5593</b>	<b>5593</b>	<b>231</b>	<b>231</b>	<b>5631</b>	<b>5631</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>4206</b>	<b>4206</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.