

Fecha de Publicación: 30 de Julio de 2012  
 Fecha de Información: 26 de Julio 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\$1354,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.<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	358,4	266,9	213,5	292,6	43,4	55,8	10,0
15-35	184,3	397,0	359,5	104,4	24,0	66,4	13,5
36-60	1,0	28,5	0,0	0,0	28,5	1,0	0,0
61-90	42,7	36,0	0,0	0,0	21,0	27,7	15,0
91-180	31,3	32,2	20,2	0,0	11,9	31,3	0,0
>180	8,4	11,2	5,0	0,0	1,2	3,4	5,0
<b>Total</b>	<b>626,1</b>	<b>771,8</b>	<b>598,2</b>	<b>397,0</b>	<b>130,1</b>	<b>185,6</b>	<b>43,5</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	7,4 %	8,9 %	2,0 %	3,6 %
15-35	6,9 %	6,2 %	6,2 %	6,2 %
36-60	-	6,4 %	5,7 %	6,4 %
61-90	6,2 %	6,1 %	5,4 %	5,8 %
91-180	-	6,0 %	5,3 %	5,6 %
>180	5,1 %	4,5 %	4,2 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>6,5 %</b>	<b>6,7 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>5,2 %</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	23 al 27 de Julio				30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	158	90	3865	3923	157	80	2377	3125	161	59	2139	2491
Intragruppo y off-shore***	0	0	2465	1572	0	0	2048	760	0	0	1540	711
Otros	90	158	489	1325	80	157	371	911	59	161	310	788
<b>Total</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>6820</b>	<b>6820</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>4796</b>	<b>4796</b>	<b>220</b>	<b>220</b>	<b>3989</b>	<b>3989</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.