

Fecha de Publicación: 06 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 02 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\$1637,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupos y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	231,7	186,5	119,3	91,7	20,3	93,0	47,0
15-35	517,8	733,1	574,0	91,0	1,1	268,8	158,0
36-60	78,0	5,2	0,0	0,0	5,2	78,0	0,0
61-90	3,4	5,4	0,0	0,0	5,4	3,4	0,0
91-180	0,2	45,0	40,0	0,0	5,0	0,2	0,0
>180	2,1	34,0	20,0	0,0	14,0	2,1	0,0
<b>Total</b>	<b>833,1</b>	<b>1009,2</b>	<b>753,2</b>	<b>182,7</b>	<b>51,0</b>	<b>445,4</b>	<b>205,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	7,5 %	5,7 %	5,2 %
15-35	6,0 %	6,7 %	6,8 %	6,6 %
36-60	-	6,5 %	6,2 %	6,3 %
61-90	-	5,9 %	5,6 %	5,8 %
91-180	-	6,1 %	5,0 %	6,1 %
>180	-	4,3 %	4,5 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>6,7 %</b>	<b>6,5 %</b>	<b>6,3 %</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	30 de Jul. al 3 de Agosto				6 al 10 de Agosto				13 al 17 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	151	82	3276	3598	171	64	2668	2967	228	69	1772	2801
Intragrupos y off-shore***	0	0	2189	1320	0	2	1731	965	0	0	1932	464
Otros	82	151	392	939	64	169	394	861	69	228	305	744
<b>Total</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>5857</b>	<b>5857</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>4793</b>	<b>4793</b>	<b>297</b>	<b>297</b>	<b>4008</b>	<b>4008</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.