

Fecha de Publicación: 9 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 06 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\$1092,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.<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	259,2	131,2	0,0	118,2	59,2	69,0	72,0
15-35	355,4	381,6	281,9	54,0	10,7	212,4	89,0
36-60	19,3	22,9	10,0	5,0	6,9	8,3	6,0
61-90	3,2	23,3	0,6	0,0	22,7	3,2	0,0
91-180	5,1	8,4	0,0	0,0	8,4	5,1	0,0
>180	5,0	50,2	5,0	0,0	40,2	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>647,2</b>	<b>617,6</b>	<b>297,5</b>	<b>177,1</b>	<b>148,2</b>	<b>298,1</b>	<b>172,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4 %	7,6 %	3,2 %	4,5 %
15-35	5,9 %	6,2 %	6,5 %	6,3 %
36-60	6,4 %	6,9 %	6,4 %	6,5 %
61-90	-	5,9 %	5,9 %	5,9 %
91-180	-	5,9 %	5,6 %	5,8 %
>180	0,0 %	4,3 %	-	3,8 %
<b>Total</b>	<b>5,5 %</b>	<b>6,2 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,6 %</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	58	2842	2996	239	72	1861	2797	142	62	2158	2047
Intragruppo y off-shore***	0	0	1719	1076	0	0	1825	464	0	0	1364	472
Otros	58	168	393	881	72	239	370	795	62	142	280	1284
<b>Total</b>	<b>226</b>	<b>226</b>	<b>4953</b>	<b>4953</b>	<b>311</b>	<b>311</b>	<b>4056</b>	<b>4056</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>3803</b>	<b>3803</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.