

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 15 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\$1699,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.<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	316,8	191,1	111,5	198,0	29,6	68,8	50,0
15-35	412,5	685,7	545,6	150,0	24,1	146,5	116,1
36-60	21,3	63,9	10,0	0,0	43,9	11,3	10,0
61-90	20,4	5,7	0,0	0,0	5,7	20,4	0,0
91-180	44,9	30,3	10,0	0,0	15,3	39,9	5,0
>180	72,1	20,8	5,0	30,6	10,8	36,5	5,0
<b>Total</b>	<b>888,1</b>	<b>997,6</b>	<b>682,1</b>	<b>378,6</b>	<b>129,4</b>	<b>323,5</b>	<b>186,1</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	3,1 %	4,5 %	4,0 %	4,0 %
15-35	4,4 %	5,2 %	3,4 %	4,4 %
36-60	5,2 %	6,0 %	4,7 %	5,7 %
61-90	-	5,4 %	4,5 %	4,7 %
91-180	4,5 %	5,0 %	4,3 %	4,6 %
>180	4,1 %	2,6 %	3,6 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,4 %</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	2944	3502	161	75	2733	3202	30	111	1935	2355
Intragruppo y off-shore***	6	0	2126	1109	0	0	1978	545	0	0	1608	543
Otros	72	241	442	902	75	161	452	1417	111	30	311	957
<b>Total</b>	<b>319</b>	<b>319</b>	<b>5512</b>	<b>5512</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>5163</b>	<b>5163</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>3855</b>	<b>3855</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.