

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2012  
 Fecha de Información: 22 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\$2053,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	455,7	125,5	51,0	380,0	6,5	7,7	68,0
15-35	588,1	690,6	547,0	244,0	3,6	204,1	140,0
36-60	4,9	0,5	0,0	0,0	0,5	4,9	0,0
61-90	53,7	102,7	45,0	0,0	57,7	53,7	0,0
91-180	5,6	120,1	115,0	0,0	5,1	5,6	0,0
>180	65,9	57,9	37,0	0,0	10,9	55,9	10,0
<b>Total</b>	<b>1173,9</b>	<b>1097,3</b>	<b>795,0</b>	<b>624,0</b>	<b>84,3</b>	<b>331,9</b>	<b>218,0</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	2,4 %	2,6 %	2,5 %	2,5 %
15-35	5,3 %	5,5 %	4,0 %	4,9 %
36-60	-	6,3 %	4,9 %	5,0 %
61-90	-	4,2 %	5,1 %	4,5 %
91-180	-	3,9 %	4,1 %	3,9 %
>180	4,1 %	3,5 %	3,9 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>4,2 %</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	20 al 24 de Agosto				27 al 31 de Agosto				3 al 7 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	149	78	3575	3587	32	116	2491	2946	163	73	2049	2650
Intragruppo y off-shore***	0	0	2192	1105	0	0	1916	815	0	0	1903	722
Otros	78	149	474	1548	116	32	377	1023	73	163	298	877
<b>Total</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>6240</b>	<b>6240</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>4784</b>	<b>4784</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>4249</b>	<b>4249</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.