

Fecha de Publicación: 26 de Mayo de 2012  
 Fecha de Información: 24 de Mayo 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\$1268,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.<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	141,7	147,0	26,0	25,5	96,0	91,2	25,0
15-35	303,7	370,6	299,4	181,0	25,2	76,7	46,0
36-60	54,9	1,1	0,0	0,0	1,1	54,9	0,0
61-90	77,4	68,8	65,3	0,0	3,5	77,4	0,0
91-180	63,3	41,3	25,0	0,0	16,3	63,3	0,0
>180	37,3	32,9	20,0	5,0	12,9	32,3	0,0
<b>Total</b>	<b>678,3</b>	<b>661,6</b>	<b>435,7</b>	<b>211,5</b>	<b>155,0</b>	<b>395,8</b>	<b>71,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operacines 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	6,2 %	3,3 %	4,2 %	3,9 %
15-35	0,4 %	5,0 %	11,9 %	7,6 %
36-60	-	7,3 %	5,6 %	5,7 %
61-90	-	14,3 %	4,5 %	9,1 %
91-180	-	7,5 %	5,0 %	6,0 %
>180	-	5,2 %	4,4 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>7,7 %</b>	<b>6,6 %</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**

Sector	21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	57	121	2599	2889	11	113	2183	2099	21	130	2562	3023
Intragruppo y off-shore***	0	0	1567	984	0	0	1207	513	0	0	1675	667
Otros	121	57	596	888	113	11	309	1086	130	21	531	1079
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>4761</b>	<b>4761</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>3699</b>	<b>3699</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>4768</b>	<b>4768</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.