

Fecha de Publicación: 25 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 21 de Junio 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\$1244,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.<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	101,3	173,0	103,0	20,0	46,0	57,3	24,0
15-35	303,2	673,3	571,5	72,0	40,8	170,3	61,0
36-60	3,9	1,9	0,0	0,0	1,9	3,9	0,0
61-90	1,6	7,4	0,0	0,0	7,4	1,6	0,0
91-180	0,8	12,7	0,0	0,0	12,7	0,8	0,0
>180	30,5	49,8	15,0	0,0	4,8	0,5	30,0
<b>Total</b>	<b>441,3</b>	<b>918,1</b>	<b>689,5</b>	<b>92,0</b>	<b>113,6</b>	<b>234,3</b>	<b>115,0</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	5,3 %	6,3 %	6,1 %	6,1 %
15-35	5,3 %	6,4 %	5,7 %	6,1 %
36-60	-	5,5 %	5,7 %	5,6 %
61-90	-	5,9 %	5,6 %	5,9 %
91-180	-	5,0 %	4,8 %	5,0 %
>180	4,7 %	5,1 %	4,0 %	4,7 %
<b>Total</b>	<b>5,1 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>6,0 %</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	18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	68	93	3563	3471	69	91	3243	3847	85	55	1181	1553
Intragruppo y off-shore***	0	0	2300	1759	0	0	2616	1516	0	0	1069	357
Otros	93	68	529	1162	90	69	625	1120	55	85	189	529
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>6392</b>	<b>6392</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>6484</b>	<b>6484</b>	<b>140</b>	<b>140</b>	<b>2439</b>	<b>2439</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.