

Fecha de Publicación: 28 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 26 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\$1070,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.<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	287,4	235,7	28,7	44,7	68,0	103,7	139,0
15-35	247,9	285,9	238,0	135,5	17,9	82,4	30,0
36-60	60,8	14,3	0,0	0,0	14,3	60,8	0,0
61-90	27,7	0,6	0,0	0,0	0,6	27,7	0,0
91-180	23,9	2,6	0,0	0,0	2,6	23,9	0,0
>180	49,5	3,1	0,0	45,0	3,1	4,5	0,0
<b>Total</b>	<b>697,1</b>	<b>542,2</b>	<b>266,7</b>	<b>225,2</b>	<b>106,5</b>	<b>303,0</b>	<b>169,0</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	6,8 %	6,3 %	6,3 %	6,5 %
15-35	7,1 %	5,8 %	6,6 %	6,3 %
36-60	-	7,3 %	6,4 %	6,6 %
61-90	-	7,6 %	5,8 %	5,8 %
91-180	-	5,1 %	5,0 %	5,0 %
>180	-	4,9 %	4,2 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>6,8 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>6,3 %</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	25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio				9 al 13 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	70	96	3598	4218	87	57	1489	1848	50	98	2068	2450
Intragruppo y off-shore***	0	0	2750	1640	0	0	1166	386	10	0	1729	709
Otros	95	70	676	1166	57	87	240	661	88	50	302	940
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>7024</b>	<b>7024</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>2895</b>	<b>2895</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4099</b>	<b>4099</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.