

Fecha de Publicación: 24 de Mayo de 2012  
 Fecha de Información: 22 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\$1711,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,0%.<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	417,7	371,7	183,5	180,3	37,2	86,4	151,0
15-35	316,3	462,1	414,3	66,0	20,8	223,3	27,0
36-60	81,6	20,4	10,0	0,0	10,4	81,6	0,0
61-90	23,1	22,9	0,0	0,0	22,9	23,1	0,0
91-180	43,7	21,2	3,0	10,0	18,2	33,7	0,0
>180	59,0	80,6	40,0	10,0	9,6	18,0	31,0
<b>Total</b>	<b>941,5</b>	<b>978,8</b>	<b>650,8</b>	<b>266,3</b>	<b>119,0</b>	<b>466,2</b>	<b>209,0</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	5,4 %	6,9 %	4,5 %	5,5 %
15-35	7,8 %	8,1 %	8,6 %	8,3 %
36-60	-	19,7 %	6,6 %	9,2 %
61-90	-	6,9 %	6,1 %	6,5 %
91-180	-	5,6 %	8,9 %	7,8 %
>180	4,5 %	4,6 %	4,5 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>7,7 %</b>	<b>6,7 %</b>	<b>7,0 %</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**

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**	55	118	2478	2784	11	113	2001	1960	19	130	2402	2874
Intragruppo y off-shore***	0	0	1509	902	0	0	1204	513	0	0	1655	639
Otros	118	55	588	888	113	11	269	1000	130	19	443	988
<b>Total</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>4575</b>	<b>4575</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>3474</b>	<b>3474</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>4501</b>	<b>4501</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.