

Fecha de Publicación: 6 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 04 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\$1011,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	344,0	146,3	65,0	243,2	21,3	40,8	60,0
15-35	240,3	260,6	199,7	61,5	7,9	125,8	53,0
36-60	1,7	16,2	10,0	0,0	6,2	1,7	0,0
61-90	4,3	7,9	0,0	0,0	7,9	4,3	0,0
91-180	23,9	56,0	20,0	0,4	36,0	23,5	0,0
>180	20,2	8,1	0,0	15,2	3,1	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>634,3</b>	<b>495,2</b>	<b>294,7</b>	<b>320,3</b>	<b>82,5</b>	<b>196,0</b>	<b>118,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,2 %	2,7 %	6,1 %	5,2 %
15-35	5,0 %	5,8 %	5,5 %	5,6 %
36-60	-	5,6 %	4,9 %	5,6 %
61-90	-	4,0 %	4,7 %	4,2 %
91-180	-	5,1 %	4,4 %	4,9 %
>180	3,9 %	4,8 %	3,7 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,6 %</b>	<b>5,3 %</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	4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	112	3009	3520	252	90	3133	3790	75	67	1803	2500
Intragrupa y off-shore***	0	0	1990	870	0	0	2550	928	0	0	1961	620
Otros	112	33	653	1262	90	252	301	1265	67	75	246	890
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>5653</b>	<b>5653</b>	<b>342</b>	<b>342</b>	<b>5983</b>	<b>5983</b>	<b>142</b>	<b>142</b>	<b>4010</b>	<b>4010</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 intragrupo.