

Fecha de Publicación: 07 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 05 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\$1655,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	405,6	449,8	284,2	281,3	121,6	80,3	44,0
15-35	400,3	348,3	267,0	170,8	18,3	166,5	63,0
36-60	35,7	27,7	0,0	0,0	22,7	30,7	5,0
61-90	0,1	9,7	0,6	0,0	9,2	0,1	0,0
91-180	0,1	67,1	40,0	0,0	27,1	0,1	0,0
>180	20,0	2,9	0,0	20,0	2,9	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>861,8</b>	<b>905,5</b>	<b>591,8</b>	<b>472,1</b>	<b>201,8</b>	<b>277,8</b>	<b>112,0</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	4,8 %	5,6 %	4,3 %	5,0 %
15-35	4,7 %	5,2 %	5,1 %	5,1 %
36-60	2,0 %	5,8 %	5,0 %	5,1 %
61-90	-	5,5 %	4,6 %	5,5 %
91-180	-	4,8 %	4,3 %	4,8 %
>180	-	4,6 %	3,8 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,0 %</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	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**	34	110	3221	3673	254	92	3272	4017	76	70	1908	2562
Intragruppo y off-shore***	0	0	2076	1048	0	1	2698	1029	0	0	2011	670
Otros	110	34	709	1286	92	252	358	1282	70	76	246	933
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>6007</b>	<b>6007</b>	<b>346</b>	<b>346</b>	<b>6328</b>	<b>6328</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>4165</b>	<b>4165</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.