

Fecha de Publicación: 29 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 27 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\$2217,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<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	463,5	191,4	73,0	300,3	17,9	62,7	100,5
15-35	660,6	784,8	667,3	392,8	1,3	151,6	116,3
36-60	64,6	125,7	80,0	0,0	15,7	34,6	30,0
61-90	40,0	16,8	0,0	0,0	6,8	30,0	10,0
91-180	71,7	23,0	1,8	0,0	21,2	71,7	0,0
>180	25,9	6,0	1,3	25,0	4,7	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1326,3</b>	<b>1147,7</b>	<b>823,4</b>	<b>718,1</b>	<b>67,6</b>	<b>351,5</b>	<b>256,8</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 %	4,0 %	2,9 %	3,5 %
15-35	7,1 %	5,8 %	6,5 %	6,2 %
36-60	5,5 %	6,7 %	6,1 %	6,0 %
61-90	5,8 %	5,9 %	5,3 %	5,5 %
91-180	-	5,9 %	4,9 %	5,2 %
>180	-	5,2 %	4,6 %	5,1 %
<b>Total</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>4,9 %</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	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**	72	94	3890	4340	87	57	1549	1889	50	98	2289	2533
Intragruppo y off-shore***	0	0	2821	1890	0	0	1166	386	10	0	1775	854
Otros	94	72	687	1168	57	87	252	691	88	50	304	981
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>7398</b>	<b>7398</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>2967</b>	<b>2967</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>4369</b>	<b>4369</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.