

Fecha de Publicación: 17 de Mayo de 2012  
 Fecha de Información: 15 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\$1910,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.<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	309,6	231,4	208,2	84,5	3,2	205,1	20,0
15-35	556,2	688,7	529,5	106,2	29,7	320,5	129,5
36-60	10,6	20,8	15,0	0,0	5,8	10,6	0,0
61-90	132,6	15,6	0,0	0,0	15,6	132,6	0,0
91-180	20,1	9,3	0,0	0,0	9,3	20,1	0,0
>180	41,3	31,7	0,0	0,0	23,7	33,3	8,0
<b>Total</b>	<b>1070,5</b>	<b>997,4</b>	<b>752,7</b>	<b>190,7</b>	<b>87,2</b>	<b>722,3</b>	<b>157,5</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	3,8 %	6,2 %	5,2 %	5,5 %
15-35	6,8 %	6,4 %	5,5 %	6,1 %
36-60	-	6,9 %	5,5 %	6,4 %
61-90	-	6,3 %	6,0 %	6,0 %
91-180	-	6,3 %	5,1 %	5,5 %
>180	-1,0 %	4,7 %	4,4 %	3,8 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>5,8 %</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	14 al 18 de Mayo				21 al 25 de Mayo				28 de May. al 1 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	235	154	3325	4121	57	118	1836	2229	7	91	1668	1617
Intragruppo y off-shore***	0	0	2395	1100	0	0	1201	670	0	0	1006	509
Otros	154	235	544	1044	118	57	516	654	91	7	240	788
<b>Total</b>	<b>389</b>	<b>389</b>	<b>6265</b>	<b>6265</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>3554</b>	<b>3554</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>2913</b>	<b>2913</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.