

Fecha de Publicación: 04 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 31 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\$1263,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.<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	194,6	162,0	56,5	15,5	15,5	89,1	90,0
15-35	462,2	519,1	308,5	166,1	43,6	129,1	167,0
36-60	10,9	30,2	0,0	0,0	30,2	10,9	0,0
61-90	5,6	10,4	0,0	0,0	10,4	5,6	0,0
91-180	10,6	72,7	50,0	0,3	22,7	10,3	0,0
>180	2,0	39,8	35,0	0,4	4,8	1,7	0,0
<b>Total</b>	<b>685,9</b>	<b>834,2</b>	<b>450,0</b>	<b>182,3</b>	<b>127,2</b>	<b>246,7</b>	<b>257,0</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	3,1 %	2,9 %	4,9 %	3,8 %
15-35	6,4 %	5,3 %	4,4 %	5,2 %
36-60	-	6,1 %	4,5 %	5,7 %
61-90	-	5,1 %	4,3 %	4,9 %
91-180	-	5,3 %	4,3 %	5,1 %
>180	-	4,0 %	3,5 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,9 %</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	28 de May. al 1 de Junio				4 al 8 de Junio				11 al 15 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	110	3211	2575	24	121	2785	3293	246	92	2821	3598
Intragrupa y off-shore***	0	0	1397	1304	0	0	1873	729	0	0	2448	765
Otros	110	10	431	1160	121	24	583	1219	92	246	281	1187
<b>Total</b>	<b>120</b>	<b>120</b>	<b>5039</b>	<b>5039</b>	<b>145</b>	<b>145</b>	<b>5240</b>	<b>5240</b>	<b>338</b>	<b>338</b>	<b>5549</b>	<b>5549</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.