

Fecha de Publicación: 15 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 13 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\$1317,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	421,8	75,5	0,0	306,0	16,0	56,3	59,5
15-35	188,5	612,1	517,5	66,0	36,1	64,0	58,5
36-60	74,0	43,9	0,0	0,0	13,9	44,0	30,0
61-90	4,2	10,4	0,0	0,0	10,4	4,2	0,0
91-180	2,8	16,5	0,4	0,0	16,1	2,8	0,0
>180	1,6	13,8	5,0	0,0	8,8	1,6	0,0
<b>Total</b>	<b>692,8</b>	<b>772,2</b>	<b>522,9</b>	<b>372,0</b>	<b>101,3</b>	<b>172,8</b>	<b>148,0</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	3,7 %	4,4 %	3,6 %	3,6 %
15-35	6,2 %	6,0 %	5,3 %	5,9 %
36-60	3,3 %	6,0 %	5,4 %	4,8 %
61-90	-	6,0 %	5,0 %	5,7 %
91-180	-	5,2 %	4,2 %	5,0 %
>180	-	4,7 %	3,8 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>5,1 %</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	11 al 15 de Junio				18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	255	89	4167	4599	77	73	2324	2911	62	85	2691	3303
Intragruppo y off-shore***	3	1	2890	1695	0	0	2174	919	0	0	2270	1289
Otros	85	254	622	1384	73	77	372	1040	84	62	497	866
<b>Total</b>	<b>344</b>	<b>344</b>	<b>7679</b>	<b>7679</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>4870</b>	<b>4870</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>5458</b>	<b>5458</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.