

Fecha de Publicación: 21 de Junio de 2012  
 Fecha de Información: 19 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\$1782,2 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	517,9	188,7	0,0	335,5	100,7	94,4	88,0
15-35	450,5	574,2	473,5	209,0	12,2	153,0	88,5
36-60	74,0	9,5	5,0	0,0	4,5	74,0	0,0
61-90	3,1	13,8	0,0	0,0	13,8	3,1	0,0
91-180	18,1	36,4	0,0	0,0	31,4	13,1	5,0
>180	46,9	30,7	0,4	15,0	30,3	31,9	0,0
<b>Total</b>	<b>1110,5</b>	<b>853,2</b>	<b>478,9</b>	<b>559,5</b>	<b>192,7</b>	<b>369,5</b>	<b>181,5</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	6,5 %	6,9 %	3,6 %	4,7 %
15-35	6,0 %	5,9 %	4,2 %	5,2 %
36-60	-	6,2 %	5,6 %	5,7 %
61-90	-	5,7 %	5,0 %	5,6 %
91-180	5,3 %	5,7 %	5,0 %	5,5 %
>180	-	4,2 %	3,1 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>6,2 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>4,0 %</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	18 al 22 de Junio				25 al 29 de Junio				2 al 6 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	90	3156	3352	68	91	3090	3642	80	55	1095	1522
Intragruppo y off-shore***	0	0	2289	1392	0	0	2459	1474	0	0	1041	357
Otros	89	72	445	1146	91	68	599	1032	55	80	186	444
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5890</b>	<b>5890</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>6148</b>	<b>6148</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>2323</b>	<b>2323</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.