

Fecha de Publicación: 12 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 10 de Abril 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\$1339,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	180,1	188,0	78,7	62,5	48,3	56,6	61,0
15-35	298,1	414,8	354,3	128,0	14,5	124,1	46,0
36-60	39,6	43,1	40,0	15,0	3,1	24,6	0,0
61-90	31,4	1,0	0,0	0,0	1,0	31,4	0,0
91-180	79,1	62,3	40,0	0,0	6,3	63,1	16,0
>180	102,4	97,5	20,0	15,0	2,5	12,4	75,0
<b>Total</b>	<b>730,6</b>	<b>806,7</b>	<b>533,0</b>	<b>220,5</b>	<b>75,8</b>	<b>312,1</b>	<b>198,0</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	5,2 %	7,6 %	2,1 %	4,9 %
15-35	5,8 %	4,0 %	5,2 %	4,7 %
36-60	-	5,3 %	5,0 %	5,0 %
61-90	-	4,4 %	4,2 %	4,2 %
91-180	4,4 %	4,7 %	3,8 %	4,2 %
>180	3,7 %	3,7 %	3,5 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,6 %</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	9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	113	3110	3184	40	99	1732	2034	11	164	2162	2781
Intragruppo y off-shore***	0	1	1680	1080	0	0	1172	371	0	0	1683	487
Otros	113	23	615	1140	99	40	419	918	164	11	375	952
<b>Total</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>5404</b>	<b>5404</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>3323</b>	<b>3323</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>4220</b>	<b>4220</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.