

Fecha de Publicación: 17 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 13 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\$1108,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<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	140,1	201,0	148,3	93,3	36,8	30,9	16,0
15-35	260,4	408,9	282,5	145,0	52,4	41,4	74,0
36-60	5,5	15,2	0,0	0,0	15,2	5,5	0,0
61-90	31,0	36,5	0,0	0,0	15,5	10,0	21,0
91-180	0,3	29,9	25,0	0,0	4,9	0,3	0,0
>180	50,2	55,8	15,0	0,0	25,8	35,2	15,0
<b>Total</b>	<b>487,6</b>	<b>747,2</b>	<b>470,8</b>	<b>238,3</b>	<b>150,5</b>	<b>123,4</b>	<b>126,0</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	6,3 %	6,2 %	4,1 %	5,5 %
15-35	6,0 %	4,2 %	2,0 %	3,8 %
36-60	-	5,2 %	4,7 %	5,1 %
61-90	5,5 %	5,0 %	5,0 %	5,2 %
91-180	-	4,3 %	4,6 %	4,3 %
>180	3,9 %	3,9 %	4,1 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>4,3 %</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	104	3586	3302	44	109	2141	2344	11	167	2310	3076
Intragruppo y off-shore***	0	1	1719	1405	0	0	1328	559	0	0	1882	541
Otros	104	23	694	1292	109	44	515	1081	167	11	386	961
<b>Total</b>	<b>128</b>	<b>128</b>	<b>5999</b>	<b>5999</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>3984</b>	<b>3984</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>4578</b>	<b>4578</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.