

Fecha de Publicación: 19 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 17 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\$1075,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.<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	161,1	230,7	129,3	73,0	50,9	37,7	50,5
15-35	373,7	278,6	110,0	223,9	80,6	61,8	88,0
36-60	35,9	66,4	0,0	10,0	41,4	0,9	25,0
61-90	9,1	7,3	0,0	0,0	7,3	9,1	0,0
91-180	10,2	22,5	0,0	0,0	12,5	0,2	10,0
>180	43,4	28,2	0,0	0,0	10,2	25,4	18,0
<b>Total</b>	<b>633,4</b>	<b>633,7</b>	<b>239,3</b>	<b>306,8</b>	<b>202,9</b>	<b>135,1</b>	<b>191,5</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	5,6 %	5,1 %	4,8 %	5,1 %
15-35	5,9 %	5,4 %	5,0 %	5,3 %
36-60	5,6 %	5,7 %	5,5 %	5,7 %
61-90	-	5,7 %	5,2 %	5,4 %
91-180	5,0 %	4,8 %	2,9 %	4,8 %
>180	4,1 %	4,6 %	4,2 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,2 %</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	16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	110	2314	2584	11	172	2408	3185	9	61	1212	1315
Intragruppo y off-shore***	0	0	1493	627	0	0	1941	589	0	0	656	227
Otros	110	44	535	1131	172	11	431	1006	61	9	304	631
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>4342</b>	<b>4342</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>4780</b>	<b>4780</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2172</b>	<b>2172</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.