

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 18 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\$1447,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	221,7	268,3	184,0	112,0	18,2	43,6	66,1
15-35	264,2	482,8	338,3	69,0	34,5	85,2	110,0
36-60	106,7	108,0	21,0	0,0	12,0	31,7	75,0
61-90	45,2	13,9	0,0	0,0	13,9	45,2	0,0
91-180	80,4	19,3	5,0	0,0	14,3	80,4	0,0
>180	76,3	46,9	0,0	0,0	11,9	41,3	35,0
<b>Total</b>	<b>794,6</b>	<b>939,2</b>	<b>548,3</b>	<b>181,0</b>	<b>104,8</b>	<b>327,5</b>	<b>286,1</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,7 %	4,9 %	1,5 %	3,4 %
15-35	5,2 %	6,5 %	3,2 %	5,4 %
36-60	4,5 %	5,5 %	4,9 %	4,8 %
61-90	-	5,3 %	4,9 %	5,0 %
91-180	-	4,8 %	4,6 %	4,6 %
>180	3,5 %	2,1 %	3,4 %	3,3 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>3,2 %</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	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**	43	118	2406	2643	11	171	2513	3296	9	64	1250	1404
Intragrupa y off-shore***	0	0	1557	719	0	0	1996	609	0	0	721	240
Otros	118	43	530	1131	171	11	444	1048	64	9	305	632
<b>Total</b>	<b>161</b>	<b>161</b>	<b>4493</b>	<b>4493</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>4953</b>	<b>4953</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>2276</b>	<b>2276</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 intragrupo.