

Fecha de Publicación: 24 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 20 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\$1643,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.<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	648,9	324,6	157,0	488,4	18,1	11,0	149,5
15-35	267,2	551,3	367,0	73,0	46,3	56,2	138,0
36-60	18,1	4,0	0,0	0,0	4,0	18,1	0,0
61-90	1,6	18,5	10,0	0,0	8,5	1,6	0,0
91-180	0,3	13,8	0,1	0,0	13,6	0,3	0,0
>180	75,0	17,8	0,0	40,0	7,8	25,0	10,0
<b>Total</b>	<b>1011,0</b>	<b>930,0</b>	<b>534,1</b>	<b>601,4</b>	<b>98,3</b>	<b>112,1</b>	<b>297,5</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	3,2 %	4,6 %	3,9 %	3,9 %
15-35	5,7 %	5,9 %	5,4 %	5,7 %
36-60	-	6,1 %	5,3 %	5,4 %
61-90	-	5,0 %	4,9 %	5,0 %
91-180	-	4,6 %	4,0 %	4,6 %
>180	4,3 %	4,0 %	4,3 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,7 %</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**	41	113	2413	2654	12	174	3213	3608	11	67	1336	1534
Intragruppo y off-shore***	0	0	1562	723	0	0	2172	1132	0	0	772	265
Otros	113	41	536	1133	174	12	449	1093	67	11	327	636
<b>Total</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>4511</b>	<b>4511</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>5833</b>	<b>5833</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>2435</b>	<b>2435</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.