

Fecha de Publicación: 08 de Mayo de 2012  
 Fecha de Información: 04 de Mayo 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\$1617,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	465,7	282,7	156,8	345,6	36,0	30,1	90,0
15-35	329,8	517,2	421,4	93,0	3,8	144,8	92,0
36-60	1,7	2,7	0,0	0,0	2,7	1,7	0,0
61-90	0,3	4,4	0,0	0,0	4,4	0,3	0,0
91-180	60,2	163,9	72,8	0,0	51,2	20,2	40,0
>180	5,2	10,1	0,0	0,0	5,1	0,2	5,0
<b>Total</b>	<b>862,9</b>	<b>981,1</b>	<b>650,9</b>	<b>438,6</b>	<b>103,2</b>	<b>197,3</b>	<b>227,0</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	2,9 %	5,0 %	4,0 %	4,0 %
15-35	4,6 %	5,3 %	3,7 %	4,5 %
36-60	-	5,0 %	-9,2 %	-0,6 %
61-90	-	4,7 %	4,6 %	4,7 %
91-180	4,2 %	3,5 %	4,4 %	3,8 %
>180	4,1 %	4,0 %	3,5 %	4,0 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>4,2 %</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	30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo				14 al 18 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	51	1885	1985	130	112	3736	3993	212	143	2445	3227
Intragruppo y off-shore***	0	0	993	587	0	2	2065	1207	0	0	1935	745
Otros	51	22	459	766	112	128	692	1292	142	212	472	880
<b>Total</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>3337</b>	<b>3337</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>6493</b>	<b>6493</b>	<b>354</b>	<b>354</b>	<b>4852</b>	<b>4852</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.