

Fecha de Publicación: 09 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 03 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\$1009,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<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	80,2	169,1	85,0	11,3	34,1	18,9	50,0
15-35	305,4	533,2	368,9	83,0	30,3	88,4	134,0
36-60	1,1	13,4	0,0	0,0	13,4	1,1	0,0
61-90	30,1	49,0	35,0	20,0	4,0	0,1	10,0
91-180	0,6	8,8	0,0	0,0	8,8	0,6	0,0
>180	5,0	12,4	0,0	0,0	7,4	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>422,5</b>	<b>786,0</b>	<b>488,9</b>	<b>114,3</b>	<b>98,1</b>	<b>109,1</b>	<b>199,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,8 %	4,8 %	4,3 %	4,7 %
15-35	4,4 %	4,9 %	3,9 %	4,5 %
36-60	-	4,7 %	3,8 %	4,6 %
61-90	4,7 %	3,6 %	4,1 %	3,9 %
91-180	-	4,3 %	2,5 %	4,2 %
>180	3,5 %	3,7 %	-	3,6 %
<b>Total</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,5 %</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	2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	51	2338	2403	23	127	2538	2608	38	92	1661	1917
Intragrupa y off-shore***	0	0	1198	1040	0	1	1494	854	0	0	1128	359
Otros	51	12	436	529	127	21	554	1124	92	38	361	874
<b>Total</b>	<b>63</b>	<b>63</b>	<b>3972</b>	<b>3972</b>	<b>150</b>	<b>150</b>	<b>4586</b>	<b>4586</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>3150</b>	<b>3150</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.