

Fecha de Publicación: 27 de Abril de 2012  
 Fecha de Información: 25 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\$952,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.<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	178,2	68,8	26,5	139,5	15,3	11,7	27,0
15-35	321,8	367,7	213,0	90,0	19,7	96,8	135,0
36-60	48,0	17,0	0,0	0,0	7,0	38,0	10,0
61-90	26,5	21,1	0,0	15,0	11,1	1,5	10,0
91-180	20,7	42,2	0,0	0,0	42,2	20,7	0,0
>180	10,1	12,5	0,0	5,0	12,5	5,1	0,0
<b>Total</b>	<b>605,3</b>	<b>529,2</b>	<b>239,5</b>	<b>249,5</b>	<b>107,7</b>	<b>173,8</b>	<b>182,0</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	3,4 %	3,8 %	9,7 %	7,9 %
15-35	4,9 %	6,1 %	4,4 %	5,3 %
36-60	5,2 %	6,0 %	5,4 %	5,4 %
61-90	3,7 %	5,4 %	4,8 %	4,7 %
91-180	-	5,3 %	5,8 %	5,5 %
>180	-	4,4 %	4,3 %	4,4 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>5,8 %</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	23 al 27 de Abril				30 de Abr. al 4 de Mayo				7 al 11 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	174	3502	3789	13	67	1552	1621	113	106	2628	3080
Intragruppo y off-shore***	0	0	2290	1359	0	0	811	376	0	0	1768	685
Otros	174	10	424	1068	67	13	339	705	106	113	475	1106
<b>Total</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>6216</b>	<b>6216</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>2701</b>	<b>2701</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>4871</b>	<b>4871</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.