

Fecha de Publicación: 3 de Mayo de 2012  
 Fecha de Información: 30 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\$1048,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.<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	159,2	116,4	63,5	94,5	19,9	31,7	33,0
15-35	263,5	539,4	312,1	15,0	127,3	148,5	100,0
36-60	34,0	27,2	0,0	0,3	12,2	18,7	15,0
61-90	3,2	5,5	0,0	0,0	5,5	3,2	0,0
91-180	16,6	19,8	5,0	0,0	14,8	16,6	0,0
>180	1,2	10,3	0,0	0,0	10,3	1,2	0,0
<b>Total</b>	<b>477,6</b>	<b>718,5</b>	<b>380,6</b>	<b>109,8</b>	<b>189,9</b>	<b>219,8</b>	<b>148,0</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	8,6 %	7,8 %	8,1 %	8,1 %
15-35	4,9 %	5,7 %	5,2 %	5,4 %
36-60	5,2 %	6,6 %	4,9 %	5,4 %
61-90	-	5,4 %	4,3 %	5,0 %
91-180	-	5,0 %	4,8 %	4,9 %
>180	-	4,9 %	3,7 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,2 %</b>	<b>6,1 %</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**	21	57	1821	1911	116	108	2744	3305	207	140	2234	2982
Intragruppo y off-shore***	0	0	967	559	0	0	1830	690	0	0	1806	692
Otros	57	21	422	740	108	116	597	1176	140	207	453	819
<b>Total</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>3209</b>	<b>3209</b>	<b>224</b>	<b>224</b>	<b>5171</b>	<b>5171</b>	<b>347</b>	<b>347</b>	<b>4493</b>	<b>4493</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.