

Fecha de Publicación: 7 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 03 de Febrero 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\$1218,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,5%.<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	138,6	223,4	110,0	1,9	9,4	32,7	104,0
15-35	393,0	446,3	205,7	171,0	80,1	61,5	160,5
36-60	25,7	48,9	0,0	0,0	23,9	0,7	25,0
61-90	59,9	23,1	0,0	0,0	23,1	59,9	0,0
91-180	25,4	44,0	0,4	0,0	43,6	25,4	0,0
>180	43,6	41,6	0,0	36,2	35,6	1,4	6,0
<b>Total</b>	<b>686,2</b>	<b>827,2</b>	<b>316,0</b>	<b>209,0</b>	<b>215,7</b>	<b>181,7</b>	<b>295,5</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	7,5 %	10,0 %	0,4 %	7,2 %
15-35	2,5 %	2,9 %	2,3 %	2,6 %
36-60	2,8 %	3,1 %	2,0 %	2,9 %
61-90	-	3,1 %	2,4 %	2,6 %
91-180	-	2,8 %	2,4 %	2,6 %
>180	2,7 %	2,8 %	2,4 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>3,5 %</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	30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	4	184	2389	2229	9	178	2026	2255	13	150	2812	2184
Intragruppo y off-shore***	0	0	1278	1184	0	0	1326	725	0	2	1281	1003
Otros	184	4	482	736	178	9	366	739	150	11	438	1345
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>4149</b>	<b>4149</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>3719</b>	<b>3719</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>4532</b>	<b>4532</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.