

Fecha de Publicación: 10 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 08 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\$1558,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.<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	197,9	521,6	236,4	11,4	105,2	6,5	180,0
15-35	331,7	256,2	99,2	170,0	8,7	13,4	148,3
36-60	78,8	56,6	38,2	0,0	8,5	68,8	10,0
61-90	281,9	217,5	0,0	7,6	67,5	124,3	150,0
91-180	0,4	32,7	19,0	0,0	13,7	0,4	0,0
>180	44,2	39,9	22,1	4,0	5,3	27,7	12,5
<b>Total</b>	<b>934,9</b>	<b>1124,5</b>	<b>414,9</b>	<b>193,0</b>	<b>208,8</b>	<b>241,1</b>	<b>500,8</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	1,7 %	2,0 %	-0,6 %	1,8 %
15-35	3,1 %	2,3 %	2,6 %	2,7 %
36-60	3,3 %	3,8 %	2,2 %	2,5 %
61-90	3,0 %	2,7 %	2,4 %	2,7 %
91-180	-	3,1 %	2,1 %	3,1 %
>180	2,2 %	2,9 %	2,6 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,4 %</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	6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	190	2462	2885	14	162	3085	2946	6	184	1623	2033
Intragruppo y off-shore***	0	0	1609	881	7	2	1628	1036	0	0	1276	477
Otros	190	9	465	771	155	12	624	1355	184	6	271	660
<b>Total</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>4536</b>	<b>4536</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>5337</b>	<b>5337</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>3170</b>	<b>3170</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.