

Fecha de Publicación: 15 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 13 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\$1137,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<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	274,9	343,1	78,0	29,0	24,1	4,9	241,0
15-35	277,0	387,3	217,5	90,5	4,8	21,5	165,0
36-60	82,6	52,1	0,0	0,0	7,1	37,6	45,0
61-90	65,4	19,6	0,0	0,0	4,6	50,4	15,0
91-180	20,0	19,1	0,0	4,0	19,1	16,0	0,0
>180	50,0	62,9	4,0	0,0	8,9	0,0	50,0
<b>Total</b>	<b>769,8</b>	<b>884,1</b>	<b>299,5</b>	<b>123,5</b>	<b>68,6</b>	<b>130,3</b>	<b>516,0</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 %	3,0 %	1,7 %	3,2 %
15-35	3,4 %	3,9 %	3,3 %	3,6 %
36-60	3,8 %	4,7 %	3,4 %	3,7 %
61-90	4,1 %	3,3 %	3,2 %	3,4 %
91-180	-	3,7 %	3,2 %	3,5 %
>180	2,5 %	3,1 %	-	2,7 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,4 %</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	13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 2 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	165	3678	4134	10	186	1731	2162	8	291	2323	2046
Intragruppo y off-shore***	7	2	2047	1181	0	0	1318	501	0	0	937	1016
Otros	158	13	992	1402	186	10	283	670	291	8	576	774
<b>Total</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>6717</b>	<b>6717</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>3332</b>	<b>3332</b>	<b>299</b>	<b>299</b>	<b>3837</b>	<b>3837</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.