

Fecha de Publicación: 18 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 16 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\$1477,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	355,3	433,4	192,0	143,5	106,4	76,8	135,0
15-35	298,6	297,7	220,5	145,0	12,5	88,8	64,8
36-60	12,2	6,8	0,0	0,0	6,8	12,2	0,0
61-90	167,9	39,3	0,0	0,0	34,3	162,9	5,0
91-180	2,2	54,2	10,0	0,0	44,2	2,2	0,0
>180	13,0	6,5	0,0	5,0	1,5	3,0	5,0
<b>Total</b>	<b>849,2</b>	<b>837,9</b>	<b>422,5</b>	<b>293,5</b>	<b>205,7</b>	<b>345,9</b>	<b>209,8</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	4,6 %	3,4 %	1,6 %	3,1 %
15-35	5,0 %	3,5 %	3,6 %	3,7 %
36-60	-	4,6 %	3,2 %	3,7 %
61-90	3,3 %	3,0 %	3,1 %	3,1 %
91-180	-	2,9 %	2,5 %	2,9 %
>180	2,8 %	3,1 %	2,8 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,3 %</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	170	4108	4646	12	189	2004	2594	8	299	2586	2347
Intragruppo y off-shore***	7	2	2291	1473	0	0	1564	617	0	0	1092	1078
Otros	162	12	1187	1466	189	12	325	680	299	8	657	910
<b>Total</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>7585</b>	<b>7585</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>3892</b>	<b>3892</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>4335</b>	<b>4335</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.