

Fecha de Publicación: 21 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 17 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\$1088,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	332,1	301,4	43,5	89,1	23,9	9,0	234,0
15-35	123,7	308,9	204,0	72,0	80,9	27,7	24,0
36-60	19,0	11,0	0,0	0,0	11,0	19,0	0,0
61-90	35,1	68,9	15,0	0,0	18,9	0,1	35,0
91-180	7,3	23,3	0,0	0,0	23,3	7,3	0,0
>180	55,0	115,5	0,0	15,0	95,5	20,0	20,0
<b>Total</b>	<b>572,3</b>	<b>829,0</b>	<b>262,5</b>	<b>176,1</b>	<b>253,5</b>	<b>83,2</b>	<b>313,0</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	3,7 %	3,9 %	1,5 %	3,2 %
15-35	4,2 %	5,0 %	4,0 %	4,7 %
36-60	-	4,2 %	4,0 %	4,1 %
61-90	3,3 %	3,7 %	2,9 %	3,5 %
91-180	-	3,1 %	2,6 %	3,0 %
>180	2,9 %	3,0 %	2,7 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>3,6 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>3,7 %</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	168	4120	4651	12	203	2328	2856	8	304	2594	2362
Intragruppo y off-shore***	7	2	2296	1478	0	0	1593	707	0	0	1101	1078
Otros	161	12	1187	1474	203	12	329	686	304	8	658	913
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>7603</b>	<b>7603</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>4249</b>	<b>4249</b>	<b>312</b>	<b>312</b>	<b>4353</b>	<b>4353</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.