

Fecha de Publicación: 6 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 02 de Marzo 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\$1174,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	246,1	205,7	125,9	85,5	17,8	98,6	62,0
15-35	254,6	387,6	224,0	115,0	32,6	8,6	131,0
36-60	68,1	59,8	0,0	0,0	24,8	33,1	35,0
61-90	42,7	48,6	5,5	0,0	8,1	7,7	35,0
91-180	6,8	25,4	0,0	0,0	25,4	6,8	0,0
>180	79,2	13,2	2,0	75,0	11,2	4,2	0,0
<b>Total</b>	<b>697,5</b>	<b>740,3</b>	<b>357,4</b>	<b>275,5</b>	<b>119,9</b>	<b>159,0</b>	<b>263,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	3,7 %	5,1 %	4,4 %
15-35	2,9 %	4,8 %	3,6 %	3,9 %
36-60	0,0 %	5,2 %	4,2 %	2,9 %
61-90	3,0 %	3,8 %	4,0 %	3,3 %
91-180	-	3,5 %	3,4 %	3,4 %
>180	-	3,6 %	2,9 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>3,9 %</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	27 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo				12 al 16 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	256	3338	3084	14	139	2918	3035	11	157	2329	3066
Intragrupo y off-shore***	0	0	1624	1421	0	2	1567	1298	0	0	1849	938
Otros	256	11	710	1167	139	13	535	686	157	11	418	593
<b>Total</b>	<b>266</b>	<b>266</b>	<b>5672</b>	<b>5672</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>5019</b>	<b>5019</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4596</b>	<b>4596</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 intragrupo.