

Fecha de Publicación: 15 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 13 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\$1533,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	297,8	494,5	62,0	68,0	245,5	42,8	187,0
15-35	258,5	338,7	160,7	89,0	61,0	52,5	117,0
36-60	141,8	70,8	35,0	0,0	25,8	131,8	10,0
61-90	38,6	13,4	10,0	0,0	3,4	38,6	0,0
91-180	16,1	61,4	5,0	10,0	56,4	6,1	0,0
>180	28,2	87,1	50,2	22,8	36,9	5,4	0,0
<b>Total</b>	<b>781,1</b>	<b>1066,0</b>	<b>322,9</b>	<b>189,8</b>	<b>429,1</b>	<b>277,3</b>	<b>314,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	7,0 %	9,4 %	3,1 %	7,6 %
15-35	5,8 %	4,3 %	2,6 %	4,3 %
36-60	4,5 %	3,9 %	2,9 %	3,3 %
61-90	-	4,5 %	4,0 %	4,0 %
91-180	-	4,0 %	3,1 %	3,8 %
>180	-	3,4 %	0,2 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>6,5 %</b>	<b>6,5 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>5,5 %</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	12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	171	3364	4040	11	95	2088	2358	17	212	2874	2870
Intragrupa y off-shore***	5	0	2327	1318	0	0	1266	784	0	0	1275	760
Otros	165	13	503	835	95	11	501	712	212	17	635	1155
<b>Total</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>6193</b>	<b>6193</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>3854</b>	<b>3854</b>	<b>229</b>	<b>229</b>	<b>4784</b>	<b>4784</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.