

Fecha de Publicación: 20 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 15 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\$1084,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.<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	153,9	113,2	26,5	67,5	34,7	34,4	52,0
15-35	220,1	427,9	318,5	71,8	32,4	71,3	77,0
36-60	76,3	7,4	0,0	27,1	7,4	49,2	0,0
61-90	23,7	35,5	25,0	0,0	10,5	23,7	0,0
91-180	74,2	29,9	5,0	50,3	9,9	9,0	15,0
>180	53,3	32,9	2,0	29,0	10,9	4,3	20,0
<b>Total</b>	<b>601,6</b>	<b>646,8</b>	<b>377,0</b>	<b>245,7</b>	<b>105,8</b>	<b>191,9</b>	<b>164,0</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	5,9 %	2,3 %	4,2 %	4,0 %
15-35	4,3 %	4,7 %	4,9 %	4,7 %
36-60	-	4,7 %	4,8 %	4,8 %
61-90	-	4,5 %	4,4 %	4,4 %
91-180	3,8 %	3,9 %	3,6 %	3,8 %
>180	4,1 %	3,8 %	4,3 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,4 %</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	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**	14	168	3486	4154	12	105	2080	2416	19	218	3066	2868
Intragruppo y off-shore***	5	0	2379	1392	0	0	1287	796	0	0	1275	800
Otros	163	14	534	852	105	12	487	642	218	19	633	1307
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>6399</b>	<b>6399</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>3854</b>	<b>3854</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>4974</b>	<b>4974</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.