

Fecha de Publicación: 26 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 22 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\$1119,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.<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	196,7	209,8	110,5	35,0	80,8	143,2	18,5
15-35	193,1	447,3	359,5	54,5	19,0	69,9	68,8
36-60	3,9	9,6	0,0	0,0	9,6	3,9	0,0
61-90	76,7	1,4	0,0	60,0	1,4	16,7	0,0
91-180	24,3	20,7	0,0	0,0	3,7	7,3	17,0
>180	37,9	7,2	0,0	25,0	2,2	7,9	5,0
<b>Total</b>	<b>532,7</b>	<b>696,0</b>	<b>470,0</b>	<b>174,5</b>	<b>116,8</b>	<b>248,9</b>	<b>109,3</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	2,3 %	5,9 %	5,1 %	5,3 %
15-35	4,7 %	4,4 %	4,4 %	4,5 %
36-60	-	5,0 %	4,5 %	4,9 %
61-90	-	5,1 %	4,5 %	4,6 %
91-180	4,3 %	4,7 %	4,0 %	4,3 %
>180	3,8 %	4,7 %	3,7 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,9 %</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	19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	111	2629	2916	20	226	3431	3163	0	56	1675	2117
Intragruppo y off-shore***	0	0	1619	992	0	0	1431	922	0	0	1176	777
Otros	111	15	529	869	226	20	661	1438	56	0	352	309
<b>Total</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>4777</b>	<b>4777</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>5523</b>	<b>5523</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>3203</b>	<b>3203</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.