

Fecha de Publicación: 14 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 10 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\$1279,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,6%.<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	162,3	319,4	49,0	15,0	135,4	12,3	135,0
15-35	230,6	349,4	217,0	118,3	29,4	9,3	103,0
36-60	11,5	15,9	0,0	0,0	15,9	11,5	0,0
61-90	232,9	154,7	70,0	25,0	22,7	145,9	62,0
91-180	5,5	31,6	0,0	0,0	31,5	5,4	0,0
>180	55,5	55,7	0,0	10,0	10,7	0,5	45,0
<b>Total</b>	<b>698,2</b>	<b>926,7</b>	<b>336,0</b>	<b>168,3</b>	<b>245,7</b>	<b>184,9</b>	<b>345,0</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	2,8 %	0,2 %	1,5 %	1,4 %
15-35	4,6 %	3,8 %	1,3 %	3,3 %
36-60	-	4,0 %	3,0 %	3,6 %
61-90	2,6 %	2,5 %	2,9 %	2,7 %
91-180	2,7 %	3,1 %	2,9 %	3,1 %
>180	2,3 %	2,9 %	2,8 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,6 %</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	6 al 10 de Febrero				13 al 17 de Febrero				20 al 24 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	188	2503	2942	13	171	3462	3835	6	184	1672	2123
Intragruppo y off-shore***	0	0	1656	896	7	2	1969	1176	0	0	1318	477
Otros	188	9	471	792	163	12	977	1397	184	6	279	670
<b>Total</b>	<b>197</b>	<b>197</b>	<b>4630</b>	<b>4630</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>6408</b>	<b>6408</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>3270</b>	<b>3270</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.