

Fecha de Publicación: 23 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 21 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\$1736,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<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	695,1	386,4	192,5	412,5	28,9	117,6	165,0
15-35	214,5	445,6	344,0	67,1	3,6	49,5	98,0
36-60	71,8	36,4	0,0	5,0	1,4	31,8	35,0
61-90	0,0	16,4	0,0	0,0	16,4	0,0	0,0
91-180	30,2	22,0	0,0	0,0	22,0	30,2	0,0
>180	26,1	90,0	5,0	15,0	85,0	11,1	0,0
<b>Total</b>	<b>1037,7</b>	<b>996,8</b>	<b>541,5</b>	<b>499,6</b>	<b>157,3</b>	<b>240,2</b>	<b>298,0</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	4,0 %	5,6 %	2,5 %	3,5 %
15-35	4,8 %	4,8 %	4,1 %	4,6 %
36-60	4,2 %	5,4 %	3,7 %	4,0 %
61-90	-	4,2 %	2,6 %	4,2 %
91-180	-	4,6 %	3,2 %	3,8 %
>180	-	3,0 %	2,8 %	3,0 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>2,9 %</b>	<b>3,8 %</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	20 al 24 de Febrero				27 de Feb. al 2 de Marzo				5 al 9 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	198	2909	3069	10	310	2727	2542	4	115	1858	2095
Intragruppo y off-shore***	0	0	1677	1152	0	0	1216	1081	0	0	996	735
Otros	198	12	327	692	310	10	687	1007	115	4	424	448
<b>Total</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>4913</b>	<b>4913</b>	<b>320</b>	<b>320</b>	<b>4631</b>	<b>4631</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>3277</b>	<b>3277</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.