

Fecha de Publicación: 28 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 26 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\$1327,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	350,1	404,8	140,0	121,5	204,8	168,6	60,0
15-35	274,2	167,5	95,0	117,0	11,5	96,2	61,0
36-60	43,6	42,4	35,0	12,0	7,4	31,6	0,0
61-90	3,5	3,5	0,0	0,0	3,5	3,5	0,0
91-180	36,4	30,2	5,0	5,0	25,2	31,4	0,0
>180	37,2	74,7	30,0	15,0	24,7	2,2	20,0
<b>Total</b>	<b>744,9</b>	<b>723,0</b>	<b>305,0</b>	<b>270,5</b>	<b>277,0</b>	<b>333,4</b>	<b>141,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,3 %	4,4 %	4,0 %	4,2 %
15-35	4,6 %	4,8 %	4,7 %	4,7 %
36-60	-	4,4 %	4,4 %	4,4 %
61-90	-	4,5 %	3,7 %	4,1 %
91-180	-	4,2 %	3,7 %	3,9 %
>180	3,6 %	3,8 %	3,3 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,3 %</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	26 al 30 de Marzo				2 al 6 de Abril				9 al 13 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	223	3984	3691	0	56	1774	2216	10	106	1993	2210
Intragrupo y off-shore***	0	0	1684	1129	0	0	1185	799	0	0	1291	729
Otros	222	20	877	1725	56	0	402	346	106	10	446	791
<b>Total</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>6545</b>	<b>6545</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>3360</b>	<b>3360</b>	<b>117</b>	<b>117</b>	<b>3730</b>	<b>3730</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.