

Fecha de Publicación: 22 de Febrero de 2012  
 Fecha de Información: 20 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\$122,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	43,6	16,0	6,5	38,6	9,5	5,0	0,0
15-35	11,5	13,6	8,0	6,0	2,6	2,5	3,0
36-60	0,7	4,1	0,1	0,0	4,0	0,7	0,0
61-90	10,0	19,8	0,0	0,0	9,8	0,0	10,0
91-180	0,1	5,8	0,0	0,0	5,8	0,1	0,0
>180	0,0	10,3	0,0	0,0	10,3	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>65,8</b>	<b>69,5</b>	<b>14,6</b>	<b>44,6</b>	<b>42,0</b>	<b>8,2</b>	<b>13,0</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	-	5,8 %	5,6 %	5,6 %
15-35	4,2 %	4,4 %	4,2 %	4,3 %
36-60	-	5,0 %	2,9 %	4,7 %
61-90	3,3 %	3,9 %	2,8 %	3,6 %
91-180	-	3,9 %	2,7 %	3,9 %
>180	-	3,1 %	-	3,1 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,6 %</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	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**	13	204	2367	2860	8	309	2597	2364	4	115	1836	2079
Intragruppo y off-shore***	0	0	1599	743	0	0	1101	1078	0	0	981	735
Otros	204	13	326	689	309	8	660	916	115	4	423	426
<b>Total</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>4293</b>	<b>4293</b>	<b>317</b>	<b>317</b>	<b>4358</b>	<b>4358</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>3240</b>	<b>3240</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.