

Fecha de Publicación: 15 de Marzo de 2012  
 Fecha de Información: 12 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\$1305,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.<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	309,5	361,4	140,0	33,0	5,4	60,5	216,0
15-35	311,9	489,8	265,3	59,0	20,2	48,6	204,3
36-60	63,9	20,8	20,0	3,0	0,8	60,9	0,0
61-90	0,7	0,4	0,0	0,0	0,4	0,7	0,0
91-180	5,6	101,9	55,0	0,0	41,8	0,4	5,2
>180	50,0	14,6	5,0	50,0	9,6	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>741,6</b>	<b>988,9</b>	<b>485,3</b>	<b>145,0</b>	<b>78,1</b>	<b>171,1</b>	<b>425,5</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	2,9 %	5,7 %	1,1 %	3,5 %
15-35	3,8 %	5,2 %	3,4 %	4,0 %
36-60	-	2,2 %	4,0 %	3,6 %
61-90	-	4,8 %	3,8 %	4,2 %
91-180	2,6 %	4,1 %	3,8 %	4,0 %
>180	-	3,6 %	4,0 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,3 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,7 %</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	12 al 16 de Marzo				19 al 23 de Marzo				26 al 30 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	169	3169	3854	11	94	2062	2343	17	213	2742	2538
Intragruppo y off-shore***	5	0	2285	1295	0	0	1260	779	0	0	1246	720
Otros	164	13	499	803	94	11	492	691	213	17	397	1128
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>5952</b>	<b>5952</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>3813</b>	<b>3813</b>	<b>230</b>	<b>230</b>	<b>4386</b>	<b>4386</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.