

**Fecha de Publicación: 14 de Diciembre de 2011**  
**Fecha de Información: 12 de Diciembre de 2011 <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\$835,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	115,8	179,5	104,0	98,0	60,4	2,7	15,1
15-35	180,5	180,6	129,0	79,0	11,6	61,5	40,0
36-60	0,9	44,1	1,0	0,0	43,1	0,9	0,0
61-90	8,8	4,1	0,0	0,0	4,1	8,8	0,0
91-180	16,8	51,6	40,0	0,0	11,6	16,8	0,0
>180	88,1	50,0	20,0	0,0	0,0	58,1	30,0
<b>Total</b>	<b>410,9</b>	<b>510,0</b>	<b>294,0</b>	<b>177,0</b>	<b>130,9</b>	<b>148,8</b>	<b>85,1</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	0,0 %	2,4 %	1,9 %	2,1 %
15-35	1,0 %	1,7 %	0,9 %	1,3 %
36-60	-	1,3 %	-0,5 %	1,3 %
61-90	-	1,4 %	0,4 %	0,7 %
91-180	-	1,6 %	0,5 %	1,0 %
>180	1,1 %	1,1 %	0,8 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,9 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,5 %</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**

Sector	12 al 16 de Diciembre				19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	52	412	2673	2782	7	195	2196	2602	5	325	1277	981
Intragrupa y off-shore***	3	1	1407	1296	15	0	1371	915	0	0	536	919
Otros	409	51	589	591	180	7	403	453	325	5	190	103
<b>Total</b>	<b>465</b>	<b>465</b>	<b>4669</b>	<b>4669</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>3970</b>	<b>3970</b>	<b>330</b>	<b>330</b>	<b>2002</b>	<b>2002</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.