

**Fecha de Publicación: 15 de Diciembre de 2011**  
**Fecha de Información: 13 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\$682,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.<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	119,9	139,7	80,0	27,8	15,1	47,5	44,6
15-35	134,7	183,4	90,6	97,3	62,7	7,4	30,0
36-60	22,9	56,0	4,5	0,0	31,5	2,9	20,0
61-90	8,1	5,4	1,7	0,0	3,7	8,1	0,0
91-180	17,8	2,0	0,0	0,0	2,0	17,8	0,0
>180	27,0	60,0	0,0	0,0	60,0	27,0	0,0
<b>Total</b>	<b>330,3</b>	<b>446,6</b>	<b>176,8</b>	<b>125,1</b>	<b>175,1</b>	<b>110,6</b>	<b>94,6</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	3,7 %	2,7 %	1,9 %	2,6 %
15-35	1,1 %	1,2 %	0,9 %	1,1 %
36-60	1,3 %	2,3 %	-2,8 %	1,7 %
61-90	-	1,4 %	0,8 %	1,0 %
91-180	-	1,6 %	0,9 %	1,0 %
>180	-	1,5 %	0,8 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>1,8 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>1,7 %</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**

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	416	2716	2873	7	199	2273	2633	5	325	1277	987
Intragrupa y off-shore***	3	1	1482	1323	15	0	1376	916	0	0	536	919
Otros	413	51	587	590	184	7	401	502	325	5	195	103
<b>Total</b>	<b>468</b>	<b>468</b>	<b>4786</b>	<b>4786</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>4051</b>	<b>4051</b>	<b>330</b>	<b>330</b>	<b>2008</b>	<b>2008</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.