

**Fecha de Publicación: 16 de Diciembre de 2011**  
**Fecha de Información: 14 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\$942,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	301,7	323,9	157,6	124,0	13,3	24,7	153,0
15-35	147,0	235,0	169,3	90,0	21,6	12,9	44,1
36-60	43,8	30,1	20,0	0,0	10,1	43,8	0,0
61-90	1,8	7,4	0,0	0,0	7,4	1,8	0,0
91-180	6,5	3,6	0,0	0,0	3,6	6,5	0,0
>180	35,1	3,9	0,0	0,0	3,9	35,1	0,0
<b>Total</b>	<b>535,8</b>	<b>603,9</b>	<b>346,8</b>	<b>214,0</b>	<b>60,0</b>	<b>124,7</b>	<b>197,1</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	0,1 %	0,3 %	2,0 %	0,7 %
15-35	1,0 %	1,8 %	0,9 %	1,4 %
36-60	-	2,1 %	-2,4 %	-0,6 %
61-90	-	1,5 %	0,3 %	1,2 %
91-180	-	1,9 %	0,8 %	1,2 %
>180	-	1,7 %	0,9 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>1,3 %</b>	<b>0,8 %</b>	<b>0,9 %</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	411	2850	2959	9	185	2429	2888	5	326	1289	986
Intragrupa y off-shore***	3	1	1488	1378	0	0	1543	975	0	0	536	929
Otros	408	50	591	592	185	9	413	521	326	5	195	105
<b>Total</b>	<b>463</b>	<b>463</b>	<b>4929</b>	<b>4929</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>4385</b>	<b>4385</b>	<b>331</b>	<b>331</b>	<b>2020</b>	<b>2020</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.