

Fecha de Publicación: 10 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 05 de Enero 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\$859,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<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	171,5	148,6	85,2	130,0	31,4	9,5	32,0
15-35	200,1	188,1	115,6	159,8	52,5	20,4	20,0
36-60	29,6	19,7	0,1	0,0	19,6	29,6	0,0
61-90	11,7	64,9	30,0	0,0	34,9	11,7	0,0
91-180	3,1	65,5	0,0	0,0	65,5	3,1	0,0
>180	6,3	8,4	0,0	0,0	2,4	0,3	6,0
<b>Total</b>	<b>422,4</b>	<b>495,2</b>	<b>230,9</b>	<b>289,8</b>	<b>206,3</b>	<b>74,6</b>	<b>58,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,6 %	0,7 %	0,2 %	0,8 %
15-35	0,6 %	1,0 %	0,1 %	0,5 %
36-60	-	1,2 %	0,5 %	0,8 %
61-90	-	1,4 %	1,0 %	1,3 %
91-180	-	1,8 %	0,1 %	1,7 %
>180	1,5 %	2,1 %	0,4 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>2,3 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,2 %</b>	<b>0,8 %</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	2 al 6 de Enero				9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	53	1399	1425	18	94	1894	2015	7	76	1992	1928
Intragrupa y off-shore***	0	0	964	850	0	1	1104	704	0	0	877	724
Otros	53	16	140	205	94	17	538	811	76	7	479	644
<b>Total</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2503</b>	<b>2480</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3536</b>	<b>3530</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3348</b>	<b>3295</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.