

Fecha de Publicación: 17 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 13 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\$1028,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	150,3	195,6	160,0	108,7	34,6	40,6	1,0
15-35	143,9	258,0	202,3	110,5	29,8	7,4	26,0
36-60	0,4	27,3	0,0	0,0	27,3	0,4	0,0
61-90	38,4	25,6	0,0	22,0	25,6	16,4	0,0
91-180	37,1	44,1	10,0	0,0	19,1	22,1	15,0
>180	110,4	63,2	30,0	86,3	9,2	0,1	24,0
<b>Total</b>	<b>480,5</b>	<b>613,8</b>	<b>402,3</b>	<b>327,5</b>	<b>145,5</b>	<b>87,0</b>	<b>66,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,0 %	0,6 %	0,3 %	0,4 %
15-35	0,9 %	0,5 %	0,4 %	0,5 %
36-60	-	1,4 %	0,2 %	1,4 %
61-90	-	2,0 %	1,0 %	1,4 %
91-180	1,3 %	1,9 %	1,3 %	1,6 %
>180	1,8 %	2,1 %	2,0 %	2,0 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>1,0 %</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	9 al 13 de Enero				16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	82	2318	2402	8	85	2526	2270	5	146	1721	1876
Intragruppo y off-shore***	0	1	1303	1139	0	0	1074	1046	0	0	1139	663
Otros	82	20	661	741	85	8	521	805	146	5	387	707
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>4282</b>	<b>4282</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>4121</b>	<b>4121</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>3247</b>	<b>3247</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.