

Fecha de Publicación: 20 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 18 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\$1279,8 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	315,0	117,7	16,7	223,5	23,0	13,4	78,0
15-35	363,5	334,8	213,0	173,5	37,3	105,5	84,5
36-60	112,4	34,6	0,0	5,0	19,6	92,4	15,0
61-90	7,1	34,6	13,8	0,0	20,9	7,1	0,0
91-180	8,2	71,2	30,0	5,0	41,2	3,2	0,0
>180	30,0	28,1	0,0	30,0	28,1	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>836,3</b>	<b>621,1</b>	<b>273,5</b>	<b>437,0</b>	<b>170,1</b>	<b>221,7</b>	<b>177,5</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	0,9 %	1,0 %	0,1 %	0,5 %
15-35	1,2 %	1,1 %	0,6 %	0,9 %
36-60	0,7 %	2,2 %	1,0 %	1,1 %
61-90	-	2,0 %	1,5 %	1,9 %
91-180	-	2,2 %	1,6 %	2,1 %
>180	-	2,4 %	1,9 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>1,0 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>0,6 %</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**

Sectores	16 al 20 de Enero				23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	89	2943	2546	8	144	1850	1953	5	196	1733	1457
Intragruppo y off-shore***	0	0	1157	1333	0	0	1150	709	0	0	875	808
Otros	89	8	621	842	144	8	392	729	196	5	291	634
<b>Total</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>4721</b>	<b>4721</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>3392</b>	<b>3392</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>2899</b>	<b>2899</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.