

Fecha de Publicación: 24 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 20 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\$1076,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.<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	147,4	124,9	78,1	101,3	29,9	29,1	17,0
15-35	227,9	365,6	266,9	87,8	5,7	47,1	93,0
36-60	66,7	86,5	47,0	27,0	9,5	9,7	30,0
61-90	17,6	4,9	0,0	16,3	4,9	1,3	0,0
91-180	41,2	23,7	0,7	15,0	23,0	26,2	0,0
>180	55,2	64,3	46,4	45,0	7,9	0,2	10,0
<b>Total</b>	<b>556,0</b>	<b>670,0</b>	<b>439,0</b>	<b>292,4</b>	<b>80,9</b>	<b>113,6</b>	<b>150,0</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	0,8 %	0,5 %	0,0 %	0,3 %
15-35	0,7 %	0,4 %	0,4 %	0,4 %
36-60	0,3 %	0,5 %	0,4 %	0,4 %
61-90	-	2,5 %	0,8 %	2,1 %
91-180	-	2,0 %	1,4 %	1,6 %
>180	2,0 %	1,9 %	1,7 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>0,6 %</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	75	2976	2575	8	129	2035	2085	5	197	1874	1574
Intragruppo y off-shore***	0	0	1157	1359	0	0	1202	820	0	0	979	890
Otros	75	8	644	842	129	8	459	792	197	5	289	678
<b>Total</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>4776</b>	<b>4776</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>3697</b>	<b>3697</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>3142</b>	<b>3142</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.