

Fecha de Publicación: 23 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 19 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\$1183,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.<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	205,7	114,8	68,0	116,3	29,8	72,3	17,0
15-35	337,9	301,9	157,1	113,0	65,9	145,9	79,0
36-60	81,1	24,2	0,0	0,0	9,2	66,1	15,0
61-90	15,4	33,3	0,0	0,0	33,3	15,4	0,0
91-180	33,3	48,4	1,0	0,0	47,4	33,3	0,0
>180	52,7	46,3	0,0	45,0	46,3	7,7	0,0
<b>Total</b>	<b>726,0</b>	<b>568,9</b>	<b>226,1</b>	<b>274,3</b>	<b>231,8</b>	<b>340,6</b>	<b>111,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\* Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	0,4 %	0,6 %	0,3 %	0,4 %
15-35	0,6 %	1,7 %	-0,7 %	0,4 %
36-60	0,5 %	1,6 %	0,8 %	0,8 %
61-90	-	1,6 %	1,0 %	1,4 %
91-180	-	1,9 %	1,4 %	1,7 %
>180	-	2,0 %	1,6 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>0,6 %</b>	<b>1,5 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,7 %</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	76	2976	2575	8	145	1946	2003	5	197	1810	1509
Intragrupa y off-shore***	0	0	1157	1359	0	0	1173	754	0	0	930	854
Otros	76	8	644	842	145	8	409	771	197	5	288	665
<b>Total</b>	<b>84</b>	<b>84</b>	<b>4776</b>	<b>4776</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>3529</b>	<b>3529</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>3028</b>	<b>3028</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.