

Fecha de Publicación: 25 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 23 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\$1142,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.<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	111,3	203,6	102,4	53,0	65,2	22,3	36,0
15-35	164,0	372,5	302,0	32,5	31,5	92,5	39,0
36-60	116,9	13,1	0,0	70,0	13,1	46,9	0,0
61-90	6,3	22,8	5,0	0,0	17,8	6,3	0,0
91-180	39,7	27,5	0,0	30,0	27,5	9,7	0,0
>180	83,1	96,3	0,0	40,0	56,3	3,1	40,0
<b>Total</b>	<b>521,3</b>	<b>735,8</b>	<b>409,4</b>	<b>225,5</b>	<b>211,4</b>	<b>180,8</b>	<b>115,0</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	0,0 %	-1,0 %	-0,1 %	-0,6 %
15-35	0,6 %	2,0 %	2,5 %	2,0 %
36-60	-	1,5 %	0,8 %	0,9 %
61-90	-	1,9 %	10,1 %	4,0 %
91-180	-	1,9 %	2,5 %	2,2 %
>180	2,0 %	2,2 %	1,9 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>1,9 %</b>	<b>1,4 %</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	23 al 27 de Enero				30 de Ene. al 3 de Febrero				6 al 10 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	126	2166	2291	5	198	1893	1602	1	180	1596	1529
Intragruppo y off-shore***	0	0	1333	896	0	0	986	897	0	0	1014	670
Otros	126	8	499	811	198	5	310	690	180	1	224	635
<b>Total</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>3998</b>	<b>3998</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>3189</b>	<b>3189</b>	<b>181</b>	<b>181</b>	<b>2833</b>	<b>2833</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.