

Fecha de Publicación: 26 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 24 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\$1175,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.<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	153,8	216,6	88,0	100,4	81,6	6,4	47,0
15-35	137,7	288,9	222,9	84,4	32,0	19,3	34,0
36-60	172,6	23,6	0,0	30,0	3,6	122,6	20,0
61-90	12,2	55,6	38,2	0,0	17,4	12,2	0,0
91-180	3,0	79,3	48,0	0,0	31,4	3,0	0,0
>180	112,1	31,5	0,2	102,0	21,3	0,1	10,0
<b>Total</b>	<b>591,3</b>	<b>695,5</b>	<b>397,2</b>	<b>316,8</b>	<b>187,2</b>	<b>163,5</b>	<b>111,0</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	0,2 %	0,6 %	0,0 %	0,3 %
15-35	0,8 %	1,0 %	0,8 %	0,9 %
36-60	1,5 %	2,6 %	1,1 %	1,2 %
61-90	-	1,8 %	0,9 %	1,4 %
91-180	-	1,7 %	0,9 %	1,6 %
>180	2,1 %	2,4 %	2,0 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,0 %</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	119	2284	2488	5	198	1936	1699	3	180	1596	1529
Intragruppo y off-shore***	0	0	1405	964	0	0	1072	929	0	0	1014	670
Otros	119	8	584	821	198	5	314	695	180	3	224	635
<b>Total</b>	<b>127</b>	<b>127</b>	<b>4273</b>	<b>4273</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>3323</b>	<b>3323</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>2834</b>	<b>2834</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.