

Fecha de Publicación: 30 de Enero de 2012  
 Fecha de Información: 26 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\$1346,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	264,3	252,2	58,2	72,7	24,1	21,7	169,9
15-35	422,8	337,9	90,7	213,3	126,2	88,6	121,0
36-60	99,4	49,7	0,0	0,0	24,7	74,4	25,0
61-90	59,8	59,4	25,0	0,0	31,4	56,8	3,0
91-180	29,9	47,7	0,0	5,0	44,7	21,9	3,0
>180	0,0	45,0	27,0	0,0	18,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>876,3</b>	<b>791,9</b>	<b>200,9</b>	<b>291,0</b>	<b>269,1</b>	<b>263,4</b>	<b>321,9</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	0,5 %	1,4 %	0,2 %	0,6 %
15-35	1,1 %	1,2 %	0,9 %	1,0 %
36-60	0,6 %	2,2 %	1,2 %	1,3 %
61-90	2,0 %	2,1 %	1,5 %	1,7 %
91-180	1,7 %	2,5 %	1,5 %	2,1 %
>180	-	2,5 %	-	2,5 %
<b>Total</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,7 %</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,1 %</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	95	2445	2632	5	204	2142	1835	3	182	1680	1657
Intragruppo y off-shore***	0	0	1447	1032	0	0	1121	1043	0	0	1066	681
Otros	95	8	631	859	204	5	321	708	182	3	234	642
<b>Total</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>4523</b>	<b>4523</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>3585</b>	<b>3585</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>2980</b>	<b>2980</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.