

Fecha de Publicación: 26 de Diciembre de 2011  
 Fecha de Información: 22 de Diciembre de 2011 <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\$445,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,9%.<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	122,9	18,8	16,0	84,5	2,8	38,4	0,0
15-35	72,7	197,1	131,5	29,3	54,1	31,9	11,5
36-60	0,5	12,2	0,0	0,0	12,2	0,5	0,0
61-90	4,8	3,3	0,0	0,0	3,3	4,8	0,0
91-180	4,9	11,9	0,0	0,0	11,9	4,9	0,0
>180	3,8	3,7	0,0	0,0	3,7	3,8	0,0
<b>Total</b>	<b>209,5</b>	<b>247,0</b>	<b>147,5</b>	<b>113,8</b>	<b>88,0</b>	<b>84,2</b>	<b>11,5</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	-	4,5 %	1,4 %	1,9 %
15-35	1,8 %	2,2 %	1,2 %	2,0 %
36-60	-	2,7 %	0,8 %	2,7 %
61-90	-	3,6 %	1,3 %	2,2 %
91-180	-	2,3 %	1,2 %	2,0 %
>180	-	1,9 %	1,0 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>1,8 %</b>	<b>2,5 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>1,9 %</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	19 al 23 de Diciembre				26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	170	2948	3112	8	317	1460	1229	3	67	948	1076
Intragruppo y off-shore***	0	0	1633	1303	0	0	663	1008	0	0	770	557
Otros	170	8	432	599	317	8	241	127	67	3	85	172
<b>Total</b>	<b>178</b>	<b>178</b>	<b>5014</b>	<b>5014</b>	<b>325</b>	<b>325</b>	<b>2364</b>	<b>2364</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>1804</b>	<b>1804</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.