

Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2011  
 Fecha de Información: 26 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\$619,9 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	37,2	3,4	0,9	35,9	2,5	1,3	0,0
15-35	274,5	125,4	109,0	216,0	1,4	43,5	15,0
36-60	0,1	145,5	142,0	0,0	3,5	0,1	0,0
61-90	1,0	1,1	0,0	0,0	1,1	1,0	0,0
91-180	46,2	0,4	0,0	0,0	0,4	46,2	0,0
>180	0,1	0,1	0,0	0,0	0,1	0,1	0,0
<b>Total</b>	<b>359,0</b>	<b>276,0</b>	<b>251,9</b>	<b>251,9</b>	<b>9,1</b>	<b>92,1</b>	<b>15,0</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	-	5,0 %	2,1 %	2,2 %
15-35	1,6 %	0,1 %	0,9 %	0,7 %
36-60	-	1,3 %	0,2 %	1,3 %
61-90	-	2,5 %	0,9 %	1,7 %
91-180	-	2,5 %	1,3 %	1,3 %
>180	-	2,1 %	0,0 %	1,2 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,1 %</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	26 al 30 de Diciembre				2 al 6 de Enero				9 al 13 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	315	1464	1243	5	67	1015	1107	8	89	1412	1697
Intragruppo y off-shore***	0	0	664	1009	0	0	770	593	0	0	986	420
Otros	315	7	254	130	67	5	88	173	89	8	445	726
<b>Total</b>	<b>322</b>	<b>322</b>	<b>2382</b>	<b>2382</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>1873</b>	<b>1873</b>	<b>97</b>	<b>97</b>	<b>2843</b>	<b>2843</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo.