

Fecha de Publicación: 29 de Diciembre de 2011  
 Fecha de Información: 27 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\$491,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.<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	60,3	56,6	40,0	50,0	13,6	7,3	3,0
15-35	167,2	120,1	80,3	85,0	3,8	46,2	36,0
36-60	4,6	4,5	0,0	0,0	4,5	4,6	0,0
61-90	17,9	16,8	0,0	0,0	16,8	17,9	0,0
91-180	22,5	12,5	10,0	0,0	2,5	22,5	0,0
>180	36,1	11,3	0,0	0,5	11,3	35,7	0,0
<b>Total</b>	<b>308,6</b>	<b>221,8</b>	<b>130,3</b>	<b>135,5</b>	<b>52,5</b>	<b>134,1</b>	<b>39,0</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	1,4 %	1,0 %	-1,3 %	-0,3 %
15-35	0,7 %	0,6 %	0,1 %	0,4 %
36-60	-	1,6 %	0,2 %	0,9 %
61-90	-	1,9 %	0,1 %	1,0 %
91-180	-	1,2 %	0,7 %	0,9 %
>180	-	2,1 %	0,9 %	1,2 %
<b>Total</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,5 %</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	312	1482	1294	5	69	1042	1123	8	88	1432	1698
Intragruppo y off-shore***	0	0	702	1025	0	0	772	612	0	0	986	435
Otros	312	7	268	132	69	5	99	178	88	8	447	731
<b>Total</b>	<b>319</b>	<b>319</b>	<b>2451</b>	<b>2451</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>1913</b>	<b>1913</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>2865</b>	<b>2865</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.