

**Fecha de Publicación: 19 de Agosto de 2011**  
**Fecha de Información: 17 de Agosto 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\$1279,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,1%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	139,8	138,1	9,5	36,0	53,6	28,8	75,0
15-35	420,6	366,3	141,5	218,5	106,8	84,1	118,0
36-60	152,0	89,5	40,0	0,0	19,5	122,0	30,0
61-90	11,6	22,9	0,0	0,0	22,9	11,6	0,0
91-180	46,2	76,1	0,0	0,0	71,1	41,2	5,0
>180	26,2	23,6	0,0	10,0	18,6	11,2	5,0
<b>Total</b>	<b>796,4</b>	<b>716,4</b>	<b>191,0</b>	<b>264,5</b>	<b>292,4</b>	<b>298,9</b>	<b>233,0</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,2 %	3,8 %	1,0 %	2,2 %
15-35	1,5 %	1,7 %	2,5 %	2,0 %
36-60	2,5 %	2,7 %	2,0 %	2,3 %
61-90	-	2,9 %	2,2 %	2,6 %
91-180	1,2 %	2,3 %	2,1 %	2,2 %
>180	1,9 %	2,2 %	1,8 %	2,0 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>2,3 %</b>	<b>2,2 %</b>	<b>2,1 %</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**

Sector	15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	84	1993	2433	18	137	1827	1806	9	189	1989	2205
Intragrupa y off-shore***	8	0	1389	724	0	0	878	535	0	0	1209	791
Otros	76	16	680	906	137	18	459	823	189	9	553	755
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>4063</b>	<b>4063</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>3164</b>	<b>3164</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>3751</b>	<b>3751</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 intragrupo.