

**Fecha de Publicación: 23 de Agosto de 2011**  
**Fecha de Información: 19 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\$790,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.<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	98,9	34,4	13,0	53,0	21,4	45,9	0,0
15-35	289,7	319,4	182,5	96,3	1,9	58,4	135,0
36-60	4,9	3,7	0,1	0,0	3,7	4,9	0,0
61-90	22,6	49,5	15,1	0,0	14,5	2,6	20,0
91-180	53,2	53,5	10,5	6,0	21,0	25,2	22,0
>180	22,0	16,1	0,5	15,0	15,6	7,0	0,0
<b>Total</b>	<b>491,3</b>	<b>476,6</b>	<b>221,6</b>	<b>170,3</b>	<b>78,0</b>	<b>144,0</b>	<b>177,0</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	-	5,4 %	3,1 %	3,7 %
15-35	1,7 %	2,4 %	2,4 %	2,2 %
36-60	-	3,1 %	2,4 %	2,7 %
61-90	2,0 %	2,4 %	1,9 %	2,2 %
91-180	1,3 %	2,5 %	2,2 %	2,1 %
>180	-	2,5 %	1,9 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,4 %</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	1994	2471	25	133	1966	1906	9	189	2026	2285
Intragrupa y off-shore***	8	0	1424	724	0	0	948	626	0	0	1267	804
Otros	77	16	683	907	133	25	480	861	189	9	575	779
<b>Total</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>4101</b>	<b>4101</b>	<b>158</b>	<b>158</b>	<b>3393</b>	<b>3393</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>3867</b>	<b>3867</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.