

**Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2011**  
**Fecha de Información: 22 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\$1121,7 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	170,9	134,1	58,0	119,0	45,1	20,9	31,0
15-35	428,6	367,2	149,0	77,0	77,2	210,6	141,0
36-60	109,2	1,1	0,0	0,0	1,1	109,2	0,0
61-90	7,7	17,3	0,0	0,0	17,3	7,7	0,0
91-180	41,4	4,0	0,0	0,0	4,0	41,4	0,0
>180	0,5	11,8	0,0	0,0	11,8	0,5	0,0
<b>Total</b>	<b>758,2</b>	<b>535,5</b>	<b>207,0</b>	<b>196,0</b>	<b>156,5</b>	<b>390,2</b>	<b>172,0</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	2,7 %	4,1 %	1,1 %	2,3 %
15-35	2,4 %	2,5 %	2,3 %	2,4 %
36-60	-	3,4 %	2,4 %	2,4 %
61-90	-	2,8 %	2,6 %	2,7 %
91-180	-	2,9 %	2,2 %	2,3 %
>180	-	2,5 %	1,9 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>2,1 %</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	22 al 26 de Agosto				29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	127	2089	1957	10	192	2073	2357	6	72	2306	2528
Intragrupa y off-shore***	0	0	960	720	0	0	1313	829	0	0	1541	856
Otros	127	25	503	874	192	10	586	786	72	6	463	926
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>3551</b>	<b>3551</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>3972</b>	<b>3972</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>4310</b>	<b>4310</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 intragrupo.