

**Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2011**  
**Fecha de Información: 26 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\$832,0 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	203,1	186,5	24,8	52,3	28,7	17,8	133,0
15-35	263,1	128,0	47,5	78,6	27,5	131,5	53,0
36-60	8,4	4,3	0,0	0,0	4,3	8,4	0,0
61-90	7,2	1,5	0,0	0,0	1,5	7,2	0,0
91-180	86,8	64,7	0,0	0,0	25,7	47,8	39,0
>180	26,3	77,1	7,0	5,0	70,1	21,3	0,0
<b>Total</b>	<b>594,9</b>	<b>462,0</b>	<b>79,3</b>	<b>135,9</b>	<b>157,7</b>	<b>234,0</b>	<b>225,0</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\* Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	0,9 %	4,8 %	2,2 %	2,1 %
15-35	2,8 %	2,3 %	1,7 %	2,0 %
36-60	-	3,1 %	2,5 %	2,7 %
61-90	-	2,6 %	2,5 %	2,5 %
91-180	2,0 %	2,5 %	2,2 %	2,2 %
>180	-	1,9 %	2,0 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>1,6 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>1,9 %</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	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**	24	119	2264	2045	14	191	2486	2612	6	74	2644	2963
Intragrupa y off-shore***	0	0	1022	847	0	0	1442	1078	0	0	1610	985
Otros	119	24	521	915	191	14	631	869	74	6	671	978
<b>Total</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>3807</b>	<b>3807</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>4559</b>	<b>4559</b>	<b>80</b>	<b>80</b>	<b>4926</b>	<b>4926</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.