

**Fecha de Publicación: 1 de Septiembre de 2011**  
**Fecha de Información: 30 de Agosto de 2011**<sup>1</sup>

**INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS (Información Revisada)**

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$944,7 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	172,7	96,4	15,0	30,0	31,4	92,7	50,0
15-35	235,6	318,6	171,0	100,0	79,6	67,6	68,0
36-60	7,0	52,6	10,0	0,0	37,6	2,0	5,0
61-90	87,0	4,9	0,0	0,0	4,9	87,0	0,0
91-180	42,6	22,4	0,0	26,0	12,4	6,6	10,0
>180	23,7	14,4	0,0	10,0	14,4	13,7	0,0
<b>Total</b>	<b>568,4</b>	<b>509,3</b>	<b>196,0</b>	<b>166,0</b>	<b>180,3</b>	<b>269,4</b>	<b>133,0</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	2,5 %	4,5 %	1,1 %	2,0 %
15-35	1,1 %	2,3 %	1,7 %	1,9 %
36-60	2,5 %	2,7 %	2,3 %	2,7 %
61-90	-	3,0 %	2,6 %	2,6 %
91-180	1,5 %	2,9 %	2,1 %	2,2 %
>180	-	2,4 %	2,0 %	2,2 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>1,7 %</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**

Sectores	29 de Ago. al 2 de Septiembre				5 al 9 de Septiembre				12 al 16 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	163	2645	2730	9	70	2820	3091	12	99	2007	1878
Intragrupa y off-shore***	0	0	1492	1100	0	0	1610	1036	0	0	1016	588
Otros	163	12	656	962	70	9	728	1032	99	12	506	1062
<b>Total</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>4793</b>	<b>4793</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>5159</b>	<b>5159</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3528</b>	<b>3528</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) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.