

**Fecha de Publicación: 2 de Septiembre de 2011**  
**Fecha de Información: 31 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\$791,7 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	94,3	52,9	30,0	90,0	22,9	4,3	0,0
15-35	292,2	247,2	96,7	186,8	111,5	66,4	39,0
36-60	27,3	30,5	0,0	0,0	30,5	27,3	0,0
61-90	5,9	23,6	15,0	0,0	8,6	5,9	0,0
91-180	0,3	39,7	10,0	0,0	29,7	0,3	0,0
>180	0,0	17,1	0,0	0,0	17,1	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>419,9</b>	<b>410,9</b>	<b>151,7</b>	<b>276,8</b>	<b>220,2</b>	<b>104,1</b>	<b>39,0</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	-	3,7 %	1,5 %	1,9 %
15-35	2,5 %	2,2 %	1,8 %	2,0 %
36-60	-	3,3 %	2,2 %	2,8 %
61-90	-	2,3 %	1,7 %	2,2 %
91-180	-	2,2 %	1,9 %	2,2 %
>180	-	2,4 %	-	2,4 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>2,4 %</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**

Sector	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
<b>Sector Financiero**</b>	12	160	2686	2729	9	91	2826	3122	13	100	2009	1883
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1492	1181	0	0	1640	1045	0	0	1016	588
<b>Otros</b>	160	12	654	922	91	9	730	1029	100	13	511	1065
<b>Total</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>4832</b>	<b>4832</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>5196</b>	<b>5196</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3536</b>	<b>3536</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.