

Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2011  
 Fecha de Información: 22 de Septiembre 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\$1407,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	110,6	116,6	29,5	24,5	61,1	60,1	26,0
15-35	382,0	513,1	361,3	196,2	74,9	108,8	77,0
36-60	36,4	41,9	0,0	3,3	15,9	7,1	26,0
61-90	29,7	1,0	0,0	15,0	1,0	14,7	0,0
91-180	91,3	73,7	20,0	0,0	13,7	51,3	40,0
>180	98,6	81,1	77,0	1,5	4,1	97,1	0,0
<b>Total</b>	<b>748,5</b>	<b>827,4</b>	<b>487,8</b>	<b>240,5</b>	<b>170,7</b>	<b>339,0</b>	<b>169,0</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	2,1 %	5,1 %	2,5 %	3,7 %
15-35	4,4 %	5,5 %	3,5 %	4,6 %
36-60	4,2 %	6,7 %	3,5 %	4,9 %
61-90	-	5,5 %	3,6 %	3,7 %
91-180	3,7 %	4,1 %	3,0 %	3,5 %
>180	-	2,6 %	2,2 %	2,4 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>4,0 %</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	19 al 23 de Septiembre				26 al 30 de Septiembre				3 al 7 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	81	3020	2950	17	380	2563	2401	11	114	2098	2187
Intragrupa y off-shore***	0	0	1610	1361	0	0	1074	912	0	0	1310	326
Otros	81	18	590	909	380	17	702	1026	114	11	253	1124
<b>Total</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>5219</b>	<b>5219</b>	<b>396</b>	<b>396</b>	<b>4339</b>	<b>4339</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>3662</b>	<b>3637</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.