

Fecha de Publicación: 05 de Octubre de 2011  
 Fecha de Información: 03 de Octubre 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\$1062,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.<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	306,9	85,2	0,0	202,8	48,2	67,1	37,0
15-35	297,4	291,0	177,5	126,3	26,5	84,1	87,0
36-60	64,0	66,9	15,0	0,0	51,9	64,0	0,0
61-90	2,1	2,9	0,0	0,0	2,9	2,1	0,0
91-180	17,7	7,5	0,0	0,0	7,5	17,7	0,0
>180	21,9	23,3	20,0	0,0	3,3	21,9	0,0
<b>Total</b>	<b>710,0</b>	<b>476,8</b>	<b>212,5</b>	<b>329,0</b>	<b>140,3</b>	<b>256,9</b>	<b>124,0</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	2,8 %	-10,6 %	1,7 %	0,1 %
15-35	1,8 %	2,4 %	1,2 %	1,8 %
36-60	-	2,5 %	1,9 %	2,2 %
61-90	-	2,8 %	1,4 %	2,2 %
91-180	-	2,8 %	2,1 %	2,3 %
>180	-	2,4 %	1,9 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,3 %</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	3 al 7 de Octubre				10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	104	3026	2943	19	79	1968	2521	10	90	1941	2009
Intragrupa y off-shore***	0	0	1531	877	0	1	1570	815	0	0	1282	666
Otros	104	20	603	1314	79	17	409	611	90	10	381	930
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5160</b>	<b>5135</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>3947</b>	<b>3946</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>3604</b>	<b>3604</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.