

**Fecha de Publicación: 11 de Octubre de 2011**  
**Fecha de Información: 07 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\$887,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<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	169,3	165,4	35,0	65,0	83,4	57,3	47,0
15-35	202,1	241,2	156,0	117,0	50,2	50,1	35,0
36-60	56,5	61,1	27,0	0,0	34,1	56,5	0,0
61-90	9,4	8,8	0,0	5,0	8,8	4,4	0,0
91-180	12,3	19,8	10,0	0,0	9,8	12,3	0,0
>180	5,5	18,4	0,0	0,0	18,4	5,5	0,0
<b>Total</b>	<b>455,2</b>	<b>514,8</b>	<b>228,0</b>	<b>187,0</b>	<b>204,8</b>	<b>186,2</b>	<b>82,0</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	2,0 %	-4,7 %	0,7 %	-1,2 %
15-35	1,7 %	1,7 %	1,1 %	1,5 %
36-60	-	2,1 %	1,5 %	1,7 %
61-90	-	2,2 %	1,6 %	1,9 %
91-180	-	2,0 %	1,2 %	1,7 %
>180	-	1,5 %	1,3 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>1,9 %</b>	<b>0,3 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,8 %</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**	19	97	3853	3456	23	76	2418	2778	11	91	2104	2100
Intragrupa y off-shore***	0	0	1794	1468	0	1	1512	979	0	0	1273	752
Otros	97	19	706	1403	76	22	571	743	91	11	459	984
<b>Total</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>6352</b>	<b>6327</b>	<b>100</b>	<b>100</b>	<b>4500</b>	<b>4500</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>3836</b>	<b>3836</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.