

**Fecha de Publicación: 19 de Octubre de 2011**  
**Fecha de Información: 14 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\$937,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	160,2	72,6	35,0	93,0	30,6	60,2	7,0
15-35	140,4	247,0	173,0	120,0	65,0	11,4	9,0
36-60	7,4	46,4	20,0	0,0	19,4	0,4	7,0
61-90	98,5	5,4	0,0	97,0	5,4	1,5	0,0
91-180	63,1	116,1	62,0	0,0	14,1	23,1	40,0
>180	40,9	42,6	0,0	0,0	2,6	0,9	40,0
<b>Total</b>	<b>510,5</b>	<b>530,2</b>	<b>290,0</b>	<b>310,0</b>	<b>137,2</b>	<b>97,5</b>	<b>103,0</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	0,0 %	1,6 %	0,8 %	1,0 %
15-35	1,5 %	1,4 %	0,4 %	1,1 %
36-60	1,4 %	2,4 %	0,7 %	2,1 %
61-90	-	2,4 %	0,4 %	0,5 %
91-180	0,8 %	0,9 %	1,6 %	1,0 %
>180	1,5 %	3,7 %	1,5 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>1,1 %</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	10 al 14 de Octubre				17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	32	66	2903	3001	18	92	2583	2469	11	124	2716	2307
Intragrupa y off-shore***	0	1	1573	1330	0	0	1378	977	0	0	1295	1186
Otros	66	31	626	771	92	18	582	1097	124	11	551	1069
<b>Total</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>5102</b>	<b>5102</b>	<b>110</b>	<b>110</b>	<b>4543</b>	<b>4543</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>4562</b>	<b>4562</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.