

Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2011  
 Fecha de Información: 18 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\$1313,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	340,4	144,5	120,0	314,5	14,5	15,9	10,0
15-35	214,8	354,5	329,8	105,0	6,8	91,8	18,0
36-60	66,1	70,6	0,0	10,0	20,6	6,1	50,0
61-90	3,5	5,6	0,0	0,0	5,6	3,5	0,0
91-180	160,2	52,3	5,0	0,0	15,3	128,2	32,0
>180	0,9	10,4	0,0	0,0	10,4	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>785,8</b>	<b>637,9</b>	<b>454,8</b>	<b>429,5</b>	<b>73,1</b>	<b>246,3</b>	<b>110,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,9 %	1,5 %	0,5 %	0,8 %
15-35	0,2 %	1,2 %	-0,4 %	0,6 %
36-60	0,7 %	2,0 %	0,8 %	1,0 %
61-90	-	2,9 %	1,2 %	2,3 %
91-180	1,2 %	1,5 %	1,3 %	1,3 %
>180	-	1,8 %	1,1 %	1,7 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,3 %</b>	<b>0,4 %</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	17 al 21 de Octubre				24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	91	2827	2533	11	124	2789	2380	8	86	2043	1750
Intragruppo y off-shore***	0	0	1428	1219	0	0	1365	1259	0	0	1253	922
Otros	91	17	597	1100	124	11	554	1070	86	8	265	890
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>4852</b>	<b>4852</b>	<b>135</b>	<b>135</b>	<b>4708</b>	<b>4708</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>3562</b>	<b>3561</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 intragruppo.