

Fecha de Publicación: 25 de Noviembre de 2011  
 Fecha de Información: 23 de Noviembre 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\$1313,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	294,2	274,5	120,0	45,0	76,5	171,2	78,0
15-35	177,8	319,3	188,6	49,0	15,8	13,8	115,0
36-60	5,6	2,3	0,0	0,0	2,3	5,6	0,0
61-90	150,3	16,8	9,0	70,0	6,8	79,3	1,0
91-180	78,3	98,9	65,0	0,0	3,9	48,3	30,0
>180	8,3	110,9	0,0	0,0	110,9	8,3	0,0
<b>Total</b>	<b>714,6</b>	<b>822,8</b>	<b>382,6</b>	<b>164,0</b>	<b>216,2</b>	<b>326,6</b>	<b>224,0</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	4,0 %	3,5 %	1,6 %	2,8 %
15-35	3,3 %	3,8 %	3,5 %	3,6 %
36-60	-	3,2 %	2,0 %	2,4 %
61-90	1,2 %	2,3 %	4,5 %	4,3 %
91-180	0,4 %	2,1 %	1,5 %	1,5 %
>180	-	1,4 %	1,0 %	1,4 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>2,7 %</b>	<b>2,9 %</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	21 al 25 de Noviembre				28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	155	2751	3112	14	192	2451	2302	5	447	1826	2193
Intragrupa y off-shore***	0	0	1690	1194	0	0	1216	1088	0	0	1104	619
Otros	155	36	612	748	192	14	485	763	447	5	317	435
<b>Total</b>	<b>190</b>	<b>190</b>	<b>5054</b>	<b>5054</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>4152</b>	<b>4152</b>	<b>451</b>	<b>451</b>	<b>3247</b>	<b>3247</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.