

**Fecha de Publicación: 26 de Octubre de 2011**  
**Fecha de Información: 24 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\$1373,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.<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	295,5	120,0	32,5	154,0	32,5	86,5	55,0
15-35	372,9	344,9	127,7	209,0	85,2	31,9	132,0
36-60	77,9	133,2	83,0	48,0	45,2	24,9	5,0
61-90	0,4	7,7	0,0	0,0	7,7	0,4	0,0
91-180	66,8	133,5	85,0	0,0	38,5	56,8	10,0
>180	5,0	23,3	2,8	0,0	15,5	0,0	5,0
<b>Total</b>	<b>818,4</b>	<b>762,5</b>	<b>331,0</b>	<b>411,0</b>	<b>224,5</b>	<b>200,4</b>	<b>207,0</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	0,9 %	10,1 %	0,5 %	2,5 %
15-35	1,4 %	2,1 %	0,9 %	1,4 %
36-60	0,0 %	1,3 %	0,9 %	1,1 %
61-90	-	2,1 %	0,8 %	2,0 %
91-180	1,4 %	1,5 %	1,2 %	1,4 %
>180	1,3 %	2,3 %	-	2,0 %
<b>Total</b>	<b>1,2 %</b>	<b>3,2 %</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,7 %</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	24 al 28 de Octubre				31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	51	111	3250	2825	8	89	2375	1919	10	124	1774	1440
Intragrupa y off-shore***	0	0	1599	1529	0	0	1288	1122	0	0	974	943
Otros	111	51	652	1147	89	8	306	929	124	10	226	592
<b>Total</b>	<b>162</b>	<b>162</b>	<b>5500</b>	<b>5500</b>	<b>98</b>	<b>98</b>	<b>3970</b>	<b>3970</b>	<b>133</b>	<b>133</b>	<b>2974</b>	<b>2974</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.