

**Fecha de Publicación: 27 de Octubre de 2011**  
**Fecha de Información: 25 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\$1083,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.<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	204,4	120,0	34,0	103,1	11,0	26,3	75,0
15-35	288,6	292,3	158,6	181,0	47,7	21,6	86,0
36-60	12,5	24,0	5,0	0,0	14,0	7,5	5,0
61-90	32,2	3,4	0,0	10,0	3,4	22,2	0,0
91-180	169,6	98,1	34,0	5,0	25,8	126,3	38,3
>180	0,0	43,0	40,0	0,0	3,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>707,3</b>	<b>580,9</b>	<b>271,6</b>	<b>299,1</b>	<b>105,0</b>	<b>203,9</b>	<b>204,3</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 %	1,2 %	0,3 %	0,6 %
15-35	0,6 %	1,1 %	0,5 %	0,8 %
36-60	1,1 %	2,0 %	0,8 %	1,5 %
61-90	-	2,3 %	1,0 %	1,1 %
91-180	4,0 %	1,3 %	1,0 %	1,6 %
>180	-	1,3 %	-	1,3 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>1,0 %</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	90	3296	2879	11	90	2520	1976	10	126	1787	1451
Intragrupa y off-shore***	0	0	1617	1547	0	0	1304	1207	0	0	974	943
Otros	90	51	653	1140	90	11	308	949	126	10	237	605
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5565</b>	<b>5565</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>4132</b>	<b>4132</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>2998</b>	<b>2998</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.