

**Fecha de Publicación: 31 de Octubre de 2011**  
**Fecha de Información: 27 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\$1320,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.<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	185,3	204,6	138,4	102,0	31,2	48,3	35,0
15-35	410,0	249,2	93,8	281,5	53,8	26,9	101,7
36-60	88,5	177,0	30,0	0,0	61,0	2,5	86,0
61-90	32,9	110,8	20,0	0,0	70,8	12,9	20,0
91-180	68,1	19,3	0,0	5,0	19,3	63,1	0,0
>180	4,6	12,7	10,0	0,0	2,7	4,6	0,0
<b>Total</b>	<b>789,3</b>	<b>773,5</b>	<b>292,2</b>	<b>388,5</b>	<b>238,7</b>	<b>158,2</b>	<b>242,7</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	0,4 %	0,4 %	0,1 %	0,3 %
15-35	0,2 %	0,4 %	-0,5 %	-0,1 %
36-60	0,2 %	1,5 %	0,5 %	0,8 %
61-90	0,6 %	1,2 %	0,3 %	1,0 %
91-180	-	1,4 %	0,5 %	0,7 %
>180	-	1,5 %	0,6 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>0,3 %</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	73	3521	3023	13	91	2672	2128	10	126	1845	1560
Intragrupa y off-shore***	0	0	1727	1740	0	0	1373	1276	0	0	1055	980
Otros	73	51	651	1136	91	13	365	1007	126	10	255	616
<b>Total</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>5898</b>	<b>5898</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>4410</b>	<b>4410</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>3156</b>	<b>3156</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.