

**Fecha de Publicación: 04 de Noviembre de 2011**  
**Fecha de Información: 02 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\$1201,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,7%.<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	209,7	46,5	10,0	156,0	9,1	26,3	27,4
15-35	415,5	328,9	201,3	286,5	38,3	39,7	89,3
36-60	19,6	42,4	28,0	10,0	14,4	9,6	0,0
61-90	55,2	34,6	0,0	0,0	14,6	35,2	20,0
91-180	97,0	25,9	23,0	5,0	2,9	92,0	0,0
>180	20,8	41,5	40,0	20,0	1,5	0,8	0,0
<b>Total</b>	<b>817,9</b>	<b>519,9</b>	<b>302,3</b>	<b>477,5</b>	<b>81,0</b>	<b>203,7</b>	<b>136,7</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	-33,6 %	0,7 %	-0,4 %	-5,4 %
15-35	0,5 %	0,3 %	0,1 %	0,2 %
36-60	-	1,0 %	0,6 %	0,8 %
61-90	0,1 %	1,3 %	0,1 %	0,3 %
91-180	-	0,6 %	-0,7 %	-0,4 %
>180	-	0,9 %	0,8 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>-6,4 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>-0,1 %</b>	<b>-0,7 %</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	31 de Oct. al 4 de Noviembre				7 al 11 de Noviembre				14 al 18 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	95	3100	2306	18	125	2116	1779	15	172	2267	2162
Intragrupa y off-shore***	0	0	1476	1569	0	1	1105	1031	0	0	1364	881
Otros	95	14	388	1088	125	17	289	701	172	15	309	897
<b>Total</b>	<b>109</b>	<b>109</b>	<b>4964</b>	<b>4964</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>3511</b>	<b>3511</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>3940</b>	<b>3940</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.