

**Fecha de Publicación: 1 de Diciembre de 2011**  
**Fecha de Información: 29 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\$1364,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	445,2	395,0	31,2	213,9	173,8	41,3	190,0
15-35	185,8	288,3	162,4	118,8	79,9	21,0	46,0
36-60	20,4	34,5	0,0	0,0	34,5	20,4	0,0
61-90	73,8	75,3	58,0	15,0	7,3	48,8	10,0
91-180	15,0	46,5	35,0	0,0	11,2	14,7	0,4
>180	22,2	9,0	5,0	10,0	4,0	12,2	0,0
<b>Total</b>	<b>762,4</b>	<b>848,7</b>	<b>291,6</b>	<b>357,7</b>	<b>310,7</b>	<b>158,3</b>	<b>246,4</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 %	3,4 %	0,5 %	1,4 %
15-35	0,1 %	1,0 %	0,5 %	0,7 %
36-60	-	1,3 %	0,8 %	1,1 %
61-90	0,7 %	0,5 %	0,6 %	0,6 %
91-180	0,9 %	0,6 %	0,7 %	0,6 %
>180	-	1,7 %	0,8 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>0,4 %</b>	<b>1,8 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,1 %</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	28 de Nov. al 2 de Diciembre				5 al 9 de Diciembre				12 al 16 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	146	2860	2631	7	706	2457	2705	21	126	1946	2004
Intragrupa y off-shore***	0	0	1355	1351	0	0	1259	827	0	0	1114	1068
Otros	146	19	548	781	706	7	325	510	126	21	468	457
<b>Total</b>	<b>164</b>	<b>164</b>	<b>4763</b>	<b>4763</b>	<b>712</b>	<b>712</b>	<b>4041</b>	<b>4041</b>	<b>147</b>	<b>147</b>	<b>3528</b>	<b>3528</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.