

**Fecha de Publicación: 1 de Noviembre de 2011**  
**Fecha de Información: 28 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\$1047,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.<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         | 227,1               | 184,5        | 77,6                      | 80,5         | 9,4           | 49,1         | 97,5           |
| 15-35        | 289,7               | 271,7        | 108,1                     | 158,5        | 43,6          | 11,2         | 120,0          |
| 36-60        | 29,4                | 137,3        | 20,0                      | 0,0          | 93,3          | 5,4          | 24,0           |
| 61-90        | 55,5                | 15,3         | 10,0                      | 43,0         | 5,3           | 12,5         | 0,0            |
| 91-180       | 22,1                | 33,6         | 0,0                       | 0,0          | 25,6          | 14,1         | 8,0            |
| >180         | 27,8                | 3,2          | 0,0                       | 0,0          | 3,2           | 27,8         | 0,0            |
| <b>Total</b> | <b>651,7</b>        | <b>645,6</b> | <b>215,7</b>              | <b>282,0</b> | <b>180,4</b>  | <b>120,2</b> | <b>249,5</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 %              | 0,7 %                        | -1,2 %        | -0,1 %       |
| 15-35        | 0,7 %              | 1,4 %                        | 0,3 %         | 0,8 %        |
| 36-60        | 0,5 %              | 0,9 %                        | 0,5 %         | 0,8 %        |
| 61-90        | -                  | 1,0 %                        | 0,4 %         | 0,5 %        |
| 91-180       | 0,4 %              | 1,3 %                        | 0,5 %         | 0,9 %        |
| >180         | -                  | 1,5 %                        | 0,4 %         | 0,6 %        |
| <b>Total</b> | <b>0,6 %</b>       | <b>1,1 %</b>                 | <b>-0,1 %</b> | <b>0,5 %</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**       | 53                  | 71         | 3528        | 3027        | 11                           | 92         | 2819        | 2218        | 11                   | 131        | 1925        | 1640        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                   | 0          | 1732        | 1740        | 0                            | 0          | 1421        | 1336        | 0                    | 0          | 1085        | 1000        |
| Otros                     | 71                  | 53         | 651         | 1143        | 92                           | 11         | 365         | 1050        | 131                  | 11         | 251         | 621         |
| <b>Total</b>              | <b>125</b>          | <b>125</b> | <b>5910</b> | <b>5910</b> | <b>103</b>                   | <b>103</b> | <b>4605</b> | <b>4605</b> | <b>142</b>           | <b>142</b> | <b>3261</b> | <b>3261</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.