

**Fecha de Publicación: 02 de Diciembre de 2011**  
**Fecha de Información: 30 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\$1105,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	324,3	378,5	160,0	143,7	82,5	44,6	136,0
15-35	286,7	246,1	84,5	165,0	49,6	9,7	112,0
36-60	5,1	20,9	0,4	0,0	20,4	5,1	0,0
61-90	25,7	27,9	17,8	0,0	10,2	25,7	0,0
91-180	3,0	27,8	0,0	0,0	27,8	3,0	0,0
>180	2,9	4,7	0,0	0,0	4,6	2,7	0,2
<b>Total</b>	<b>647,7</b>	<b>706,0</b>	<b>262,7</b>	<b>308,7</b>	<b>195,1</b>	<b>90,9</b>	<b>248,2</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-0,8 %	1,3 %	0,0 %	0,4 %
15-35	0,1 %	0,6 %	0,2 %	0,3 %
36-60	-	0,7 %	-0,1 %	0,5 %
61-90	-	0,5 %	-0,2 %	0,1 %
91-180	-	1,1 %	0,5 %	1,0 %
>180	0,8 %	3,1 %	0,2 %	2,0 %
<b>Total</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,4 %</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	135	2959	2740	11	744	2655	2915	21	115	1985	2074
Intragruppo y off-shore***	0	0	1422	1425	0	0	1332	887	0	0	1152	1093
Otros	135	19	566	781	744	11	357	542	115	21	495	466
<b>Total</b>	<b>153</b>	<b>153</b>	<b>4947</b>	<b>4947</b>	<b>755</b>	<b>755</b>	<b>4343</b>	<b>4343</b>	<b>136</b>	<b>136</b>	<b>3632</b>	<b>3632</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 intragruppo.