

**Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2011**  
**Fecha de Información: 19 de Abril 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\$791,3 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	155,8	71,3	35,0	107,0	14,3	26,8	22,0
15-35	134,6	131,2	75,5	39,0	13,7	53,6	42,0
36-60	47,3	35,9	0,0	0,0	35,9	47,3	0,0
61-90	59,8	69,2	10,0	0,0	15,8	16,4	43,4
91-180	10,4	12,7	0,0	10,0	12,7	0,4	0,0
>180	9,7	53,4	5,0	5,0	48,4	4,7	0,0
<b>Total</b>	<b>417,6</b>	<b>373,7</b>	<b>125,5</b>	<b>161,0</b>	<b>140,8</b>	<b>149,2</b>	<b>107,4</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	0,8 %	1,9 %	-3,9 %	-1,3 %
15-35	0,9 %	1,4 %	0,0 %	0,7 %
36-60	-	1,8 %	0,8 %	1,2 %
61-90	-0,1 %	1,7 %	0,8 %	0,6 %
91-180	-	1,7 %	1,1 %	1,4 %
>180	-	0,9 %	0,5 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,5 %</b>	<b>-1,0 %</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	18 al 22 de Abril				25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	99	1340	1685	16	428	2591	2891	3	234	1678	1510
Intragrupa y off-shore***	0	1	1015	570	0	0	1577	938	0	0	638	698
Otros	99	7	289	388	428	16	708	1047	234	3	412	519
<b>Total</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>2643</b>	<b>2643</b>	<b>445</b>	<b>445</b>	<b>4876</b>	<b>4876</b>	<b>237</b>	<b>237</b>	<b>2728</b>	<b>2728</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> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo