

Fecha de Publicación: 02 de Mayo de 2011  
 Fecha de Información: 28 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\$1218,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.<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	285,1	140,9	55,5	179,0	2,4	23,1	83,0
15-35	172,3	279,5	141,0	92,0	121,5	63,3	17,0
36-60	66,1	12,6	0,0	0,0	12,6	66,1	0,0
61-90	67,3	9,7	0,4	10,0	9,4	57,3	0,0
91-180	50,6	62,3	5,0	35,0	42,3	0,6	15,0
>180	37,3	35,1	10,0	10,0	15,1	17,3	10,0
<b>Total</b>	<b>678,6</b>	<b>540,1</b>	<b>211,9</b>	<b>326,0</b>	<b>203,2</b>	<b>227,6</b>	<b>125,0</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	0,9 %	0,2 %	0,2 %	0,5 %
15-35	0,0 %	0,7 %	0,0 %	0,4 %
36-60	-	2,0 %	-0,1 %	0,3 %
61-90	-	2,0 %	0,4 %	0,6 %
91-180	0,8 %	1,2 %	0,7 %	0,9 %
>180	7,5 %	1,2 %	0,6 %	2,0 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>0,8 %</b>	<b>0,2 %</b>	<b>0,6 %</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	25 al 29 de Abril				2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	349	3199	3349	5	287	2015	1816	39	194	1687	1798
Intragrupa y off-shore***	0	0	1875	1454	0	0	821	842	2	0	689	633
Otros	349	18	776	1047	287	5	430	608	193	39	760	704
<b>Total</b>	<b>366</b>	<b>366</b>	<b>5850</b>	<b>5850</b>	<b>292</b>	<b>292</b>	<b>3266</b>	<b>3266</b>	<b>233</b>	<b>233</b>	<b>3135</b>	<b>3135</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