

Fecha de Publicación: 08 de Agosto de 2011  
 Fecha de Información: 04 de Agosto 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\$1382,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.<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	98,6	288,4	219,0	53,0	69,4	45,6	0,0
15-35	246,6	471,4	345,0	101,7	86,4	104,9	40,0
36-60	21,9	0,3	0,0	0,0	0,3	21,9	0,0
61-90	32,5	1,9	0,0	0,0	1,9	32,5	0,0
91-180	38,1	61,1	43,0	0,0	8,1	28,1	10,0
>180	90,9	31,3	0,0	0,0	1,3	60,9	30,0
<b>Total</b>	<b>528,5</b>	<b>854,4</b>	<b>607,0</b>	<b>154,7</b>	<b>167,4</b>	<b>293,8</b>	<b>80,0</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	-	1,5 %	1,1 %	1,3 %
15-35	1,2 %	1,0 %	0,7 %	0,9 %
36-60	-	1,4 %	0,7 %	0,7 %
61-90	-	2,0 %	0,7 %	0,8 %
91-180	0,9 %	1,1 %	1,0 %	1,1 %
>180	1,0 %	1,4 %	1,2 %	1,1 %
<b>Total</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,0 %</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	1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	196	2234	2461	12	148	2657	2602	10	92	1547	1997
Intragrupa y off-shore***	0	0	1555	1108	0	1	1145	1038	0	0	1166	465
Otros	196	12	466	686	148	11	645	807	92	10	543	795
<b>Total</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>4256</b>	<b>4256</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>4447</b>	<b>4447</b>	<b>102</b>	<b>102</b>	<b>3256</b>	<b>3256</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