

**Fecha de Publicación: 09 de Agosto de 2011**  
**Fecha de Información: 05 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\$1024,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,6%.<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	80,1	101,5	47,0	27,0	52,9	51,5	1,6
15-35	284,1	378,2	250,0	96,0	45,2	105,1	83,0
36-60	22,0	12,4	0,0	0,0	12,4	22,0	0,0
61-90	10,5	17,7	0,0	0,0	17,7	10,5	0,0
91-180	30,1	57,1	40,0	0,0	17,1	30,1	0,0
>180	7,1	24,0	16,0	1,0	8,0	6,1	0,0
<b>Total</b>	<b>433,9</b>	<b>590,9</b>	<b>353,0</b>	<b>124,0</b>	<b>153,3</b>	<b>225,3</b>	<b>84,6</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	2,0 %	2,1 %	0,8 %	1,5 %
15-35	2,8 %	1,6 %	1,3 %	1,7 %
36-60	-	1,7 %	1,0 %	1,3 %
61-90	-	1,6 %	0,4 %	1,2 %
91-180	-	1,2 %	1,2 %	1,2 %
>180	-	1,4 %	1,0 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>2,8 %</b>	<b>1,7 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>1,6 %</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	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	199	2234	2457	12	139	2708	2667	10	91	1576	2043
Intragrupa y off-shore***	0	0	1555	1108	0	1	1186	1048	0	0	1172	482
Otros	199	12	462	686	139	11	668	847	91	10	583	806
<b>Total</b>	<b>211</b>	<b>211</b>	<b>4251</b>	<b>4251</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>4562</b>	<b>4562</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>3331</b>	<b>3331</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