

Fecha de Publicación: 12 de Agosto de 2011  
 Fecha de Información: 10 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\$1336,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,0%.<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	241,2	165,4	30,0	150,0	55,4	11,2	80,0
15-35	281,4	490,4	373,8	177,0	38,6	26,4	78,0
36-60	38,8	57,8	15,3	0,0	29,6	25,8	13,0
61-90	12,6	17,1	0,0	0,0	17,1	12,6	0,0
91-180	46,3	12,2	0,0	10,0	12,2	36,3	0,0
>180	77,2	67,2	50,0	75,0	17,2	2,2	0,0
<b>Total</b>	<b>697,4</b>	<b>810,1</b>	<b>469,0</b>	<b>412,0</b>	<b>170,1</b>	<b>114,4</b>	<b>171,0</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	5,8 %	2,7 %	0,7 %	2,5 %
15-35	1,6 %	1,9 %	2,0 %	1,9 %
36-60	0,7 %	2,0 %	1,7 %	1,7 %
61-90	-	2,3 %	1,6 %	2,0 %
91-180	-	2,0 %	1,5 %	1,6 %
>180	-	1,5 %	1,1 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>2,0 %</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	8 al 12 de Agosto				15 al 19 de Agosto				22 al 26 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	131	2986	2941	14	99	1758	2199	17	132	1585	1593
Intragrupa y off-shore***	0	1	1382	1248	8	0	1195	561	0	0	820	423
Otros	131	8	699	877	91	14	650	843	132	17	392	781
<b>Total</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>5067</b>	<b>5067</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>3603</b>	<b>3603</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>2797</b>	<b>2797</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 intragrupo.