

**Fecha de Publicación: 10 de Mayo de 2011**  
**Fecha de Información: 06 de Mayo 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\$886,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.<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	39,9	206,2	123,0	1,8	78,2	33,2	5,0
15-35	265,7	283,2	135,5	201,0	126,7	43,7	21,0
36-60	15,0	15,1	0,0	0,0	15,1	15,0	0,0
61-90	0,4	17,1	0,0	0,0	17,1	0,4	0,0
91-180	15,7	13,3	0,0	0,0	13,3	15,7	0,0
>180	0,9	13,5	0,0	0,0	13,5	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>337,7</b>	<b>548,4</b>	<b>258,5</b>	<b>202,8</b>	<b>263,9</b>	<b>108,9</b>	<b>26,0</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	0,0 %	0,3 %	-0,5 %	0,2 %
15-35	0,6 %	1,0 %	0,1 %	0,5 %
36-60	-	1,7 %	0,5 %	1,1 %
61-90	-	1,2 %	0,3 %	1,2 %
91-180	-	1,7 %	0,7 %	1,2 %
>180	-	1,9 %	0,4 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,8 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,5 %</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	2 al 6 de Mayo				9 al 13 de Mayo				16 al 20 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	196	2308	2296	44	214	2079	2147	16	136	1210	1323
Intragrupa y off-shore***	0	0	1140	1024	2	0	837	671	0	2	660	405
Otros	196	5	518	646	212	44	822	920	136	14	415	556
<b>Total</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>3967</b>	<b>3967</b>	<b>258</b>	<b>258</b>	<b>3738</b>	<b>3738</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>2285</b>	<b>2285</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