

**Fecha de Publicación: 24 de Mayo de 2011**  
**Fecha de Información: 20 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\$899,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,7	107,5	48,9	12,0	43,6	25,7	15,0
15-35	266,7	261,3	147,0	131,0	57,3	78,7	57,0
36-60	98,7	2,4	0,7	71,5	1,8	27,2	0,0
61-90	7,5	34,3	20,6	0,0	8,7	2,5	5,0
91-180	34,9	32,1	20,0	0,0	12,1	34,9	0,0
>180	1,0	0,5	0,0	0,0	0,5	1,0	0,0
<b>Total</b>	<b>461,5</b>	<b>438,2</b>	<b>237,2</b>	<b>214,5</b>	<b>124,0</b>	<b>170,0</b>	<b>77,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	2,2 %	0,5 %	1,4 %
15-35	0,7 %	1,1 %	1,1 %	1,1 %
36-60	-	1,8 %	1,2 %	1,3 %
61-90	0,5 %	0,9 %	0,7 %	0,8 %
91-180	-	0,9 %	1,1 %	1,0 %
>180	-	2,7 %	0,9 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,3 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>1,1 %</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	16 al 20 de Mayo				23 al 27 de Mayo				30 de May. al 3 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	129	1830	1869	9	214	1976	2191	4	303	1682	1998
Intragruppo y off-shore***	0	2	943	791	0	0	891	606	0	0	937	742
Otros	129	21	550	663	214	9	830	898	303	4	687	567
<b>Total</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>3323</b>	<b>3323</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>3696</b>	<b>3696</b>	<b>307</b>	<b>307</b>	<b>3307</b>	<b>3307</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 intragruppo