

**Fecha de Publicación: 02 de Junio de 2011**  
**Fecha de Información: 31 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\$1317,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.<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	261,9	264,3	108,0	116,5	44,3	33,4	112,0
15-35	240,0	293,1	110,5	141,0	119,6	36,0	63,0
36-60	32,5	42,8	5,4	0,0	12,5	7,5	25,0
61-90	24,9	20,9	0,0	0,0	20,9	24,9	0,0
91-180	70,7	55,4	20,0	0,0	25,4	60,7	10,0
>180	1,5	9,7	0,0	0,0	9,7	1,5	0,0
<b>Total</b>	<b>631,5</b>	<b>686,2</b>	<b>243,9</b>	<b>257,5</b>	<b>232,3</b>	<b>164,0</b>	<b>210,0</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	4,1 %	0,3 %	0,6 %	1,7 %
15-35	0,3 %	0,3 %	-0,5 %	0,0 %
36-60	0,4 %	0,8 %	-1,5 %	0,2 %
61-90	-	0,8 %	0,0 %	0,3 %
91-180	0,1 %	0,8 %	0,1 %	0,4 %
>180	-	1,2 %	0,7 %	1,1 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>0,4 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,7 %</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	30 de May. al 3 de Junio				6 al 10 de Junio				13 al 17 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	344	2318	2492	5	174	2226	2399	7	195	1998	2403
Intragrupa y off-shore***	0	0	1237	1096	0	0	1036	971	0	0	1373	786
Otros	344	7	750	716	174	5	751	643	195	7	647	829
<b>Total</b>	<b>351</b>	<b>351</b>	<b>4304</b>	<b>4304</b>	<b>179</b>	<b>179</b>	<b>4013</b>	<b>4013</b>	<b>202</b>	<b>202</b>	<b>4018</b>	<b>4018</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