

**Fecha de Publicación: 14 de Junio de 2011**  
**Fecha de Información: 10 de Junio 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\$741,4 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	119,1	122,1	89,1	83,4	29,0	31,7	4,0
15-35	128,6	265,4	195,0	63,0	22,2	17,4	48,2
36-60	35,9	36,8	0,0	0,0	26,8	25,9	10,0
61-90	0,1	3,1	0,0	0,0	3,1	0,1	0,0
91-180	8,1	18,4	0,0	0,0	18,4	8,1	0,0
>180	0,5	3,3	0,0	0,0	3,3	0,5	0,0
<b>Total</b>	<b>292,3</b>	<b>449,0</b>	<b>284,1</b>	<b>146,4</b>	<b>102,7</b>	<b>83,7</b>	<b>62,2</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	0,7 %	0,3 %	0,2 %	0,2 %
15-35	0,5 %	0,6 %	0,1 %	0,5 %
36-60	0,6 %	1,5 %	0,4 %	0,9 %
61-90	-	1,1 %	0,0 %	1,1 %
91-180	-	1,4 %	0,6 %	1,1 %
>180	-	0,9 %	0,7 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,2 %</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	6 al 10 de Junio				13 al 17 de Junio				20 al 24 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	172	2778	2846	16	180	2644	3038	12	190	2461	2225
Intragrupa y off-shore***	0	0	1318	1323	3	0	1756	1189	0	1	1096	996
Otros	172	8	809	736	177	16	764	937	190	10	481	817
<b>Total</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>4905</b>	<b>4905</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>5165</b>	<b>5165</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>4038</b>	<b>4038</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