

Fecha de Publicación: 24 de Junio de 2011  
 Fecha de Información: 22 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\$1085,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.<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	168,0	113,7	45,0	63,0	8,7	45,0	60,0
15-35	242,3	330,5	271,8	75,6	12,8	120,7	46,0
36-60	13,1	27,7	0,0	0,0	27,7	13,1	0,0
61-90	71,7	6,5	0,0	0,0	6,5	71,7	0,0
91-180	3,6	13,9	0,0	0,0	13,9	3,6	0,0
>180	20,0	74,2	0,0	20,0	74,2	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>518,6</b>	<b>566,5</b>	<b>316,8</b>	<b>158,6</b>	<b>143,7</b>	<b>254,0</b>	<b>106,0</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	0,3 %	1,2 %	0,8 %	0,7 %
15-35	1,4 %	1,3 %	1,2 %	1,3 %
36-60	-	2,0 %	1,1 %	1,7 %
61-90	-	1,7 %	1,0 %	1,0 %
91-180	0,6 %	1,6 %	1,0 %	1,5 %
>180	-	1,5 %	1,3 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>0,8 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>1,2 %</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	20 al 24 de Junio				27 de Jun. al 1 de Julio				4 al 8 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	165	2684	2680	7	412	2097	2159	4	169	1666	1587
Intragrupa y off-shore***	0	1	1467	1077	0	0	1063	996	14	0	866	608
Otros	165	21	529	922	412	7	707	712	155	4	384	721
<b>Total</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>4679</b>	<b>4679</b>	<b>419</b>	<b>419</b>	<b>3867</b>	<b>3867</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>2916</b>	<b>2916</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo