

Fecha de Publicación: 29 de Junio de 2011  
 Fecha de Información: 24 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\$736,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.<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	180,4	139,1	114,4	43,0	2,7	115,4	22,0
15-35	163,9	152,0	101,0	102,3	17,0	27,7	34,0
36-60	17,6	13,2	0,0	0,0	13,2	17,6	0,0
61-90	2,5	14,2	2,0	0,0	12,2	2,5	0,0
91-180	22,7	27,8	0,0	0,0	27,8	22,7	0,0
>180	0,6	2,9	0,0	0,0	2,9	0,6	0,0
<b>Total</b>	<b>387,7</b>	<b>349,2</b>	<b>217,4</b>	<b>145,3</b>	<b>75,8</b>	<b>186,4</b>	<b>56,0</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	0,8 %	0,2 %	-1,6 %	-1,1 %
15-35	1,4 %	1,3 %	1,1 %	1,3 %
36-60	-	2,2 %	1,3 %	1,7 %
61-90	-	2,1 %	1,2 %	2,0 %
91-180	-	0,3 %	1,2 %	0,7 %
>180	-	1,9 %	2,0 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>1,2 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>-0,5 %</b>	<b>0,3 %</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**

Sectores	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**	21	153	2712	2714	16	401	2369	2327	4	169	1766	1730
Intragruppo y off-shore***	0	1	1502	1101	0	0	1152	1125	14	0	968	608
Otros	153	20	528	927	401	16	744	813	155	4	425	820
<b>Total</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>4742</b>	<b>4742</b>	<b>418</b>	<b>418</b>	<b>4265</b>	<b>4265</b>	<b>173</b>	<b>173</b>	<b>3158</b>	<b>3158</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