

Fecha de Publicación: 01 de Julio de 2011  
 Fecha de Información: 29 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\$1019,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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         | 145,3               | 120,2        | 98,0                       | 50,2         | 12,2          | 85,1         | 10,0           |
| 15-35        | 254,5               | 261,9        | 163,0                      | 218,0        | 90,9          | 28,5         | 8,0            |
| 36-60        | 0,4                 | 7,2          | 0,0                        | 0,0          | 7,2           | 0,4          | 0,0            |
| 61-90        | 13,9                | 22,2         | 0,0                        | 0,0          | 22,2          | 13,9         | 0,0            |
| 91-180       | 98,6                | 48,2         | 5,0                        | 25,0         | 43,2          | 73,6         | 0,0            |
| >180         | 40,2                | 6,9          | 0,0                        | 40,0         | 6,9           | 0,2          | 0,0            |
| <b>Total</b> | <b>552,8</b>        | <b>466,7</b> | <b>266,0</b>               | <b>333,2</b> | <b>182,7</b>  | <b>201,6</b> | <b>18,0</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         | 0,0 %              | 0,6 %                        | 0,5 %        | 0,6 %        |
| 15-35        | -0,1 %             | 1,2 %                        | 0,7 %        | 0,9 %        |
| 36-60        | -                  | 1,7 %                        | 1,0 %        | 1,7 %        |
| 61-90        | -                  | 1,6 %                        | 0,9 %        | 1,3 %        |
| 91-180       | -                  | 1,7 %                        | 1,0 %        | 1,2 %        |
| >180         | -                  | 2,0 %                        | 1,3 %        | 1,6 %        |
| <b>Total</b> | <b>0,0 %</b>       | <b>1,2 %</b>                 | <b>0,7 %</b> | <b>0,9 %</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                   | 27 de Jun. al 1 de Julio |            |             |             | 4 al 8 de Julio |            |             |             | 11 al 15 de Julio |            |             |             |
|----------------------------|--------------------------|------------|-------------|-------------|-----------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|
|                            | Delivery                 |            | NDF         |             | Delivery        |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             |
|                            | C                        | V          | C           | V           | C               | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           |
| Sector Financiero**        | 17                       | 387        | 2534        | 2475        | 7               | 172        | 1858        | 1834        | 3                 | 157        | 1942        | 2154        |
| Intragruppo y off-shore*** | 0                        | 0          | 1273        | 1265        | 14              | 0          | 1013        | 653         | 0                 | 0          | 1474        | 768         |
| Otros                      | 387                      | 17         | 751         | 819         | 158             | 7          | 464         | 848         | 157               | 3          | 419         | 914         |
| <b>Total</b>               | <b>404</b>               | <b>404</b> | <b>4559</b> | <b>4559</b> | <b>179</b>      | <b>179</b> | <b>3335</b> | <b>3335</b> | <b>160</b>        | <b>160</b> | <b>3836</b> | <b>3836</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo