

Fecha de Publicación: 5 de Julio de 2011  
 Fecha de Información: 30 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\$1174,2 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	123,5	140,9	96,0	86,0	44,9	37,5	0,0
15-35	167,8	380,9	270,5	95,0	82,4	44,8	28,0
36-60	3,1	24,0	0,0	0,0	24,0	3,1	0,0
61-90	2,9	19,7	0,1	0,0	19,7	2,9	0,0
91-180	37,8	60,7	18,2	0,0	42,5	37,8	0,0
>180	131,4	81,5	0,0	110,0	76,5	16,4	5,0
<b>Total</b>	<b>466,4</b>	<b>707,8</b>	<b>384,8</b>	<b>291,0</b>	<b>290,0</b>	<b>142,4</b>	<b>33,0</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	-	3,4 %	-0,1 %	1,1 %
15-35	-0,9 %	0,6 %	0,0 %	0,3 %
36-60	-	1,2 %	-1,2 %	0,9 %
61-90	-	1,3 %	-0,2 %	1,1 %
91-180	-	1,1 %	0,6 %	0,9 %
>180	1,4 %	1,5 %	1,2 %	1,3 %
<b>Total</b>	<b>-0,5 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,4 %</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**

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**	15	382	2562	2505	8	173	1930	1885	3	160	1972	2214
Intragrupa y off-shore***	0	0	1303	1285	14	0	1029	719	0	0	1524	768
Otros	382	15	751	826	159	8	499	854	160	3	429	944
<b>Total</b>	<b>397</b>	<b>397</b>	<b>4616</b>	<b>4616</b>	<b>180</b>	<b>180</b>	<b>3458</b>	<b>3458</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>3926</b>	<b>3926</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