

**Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2011**  
**Fecha de Información: 11 de Julio 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\$1006,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.<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	122,9	118,9	88,7	26,4	3,3	69,5	27,0
15-35	256,4	249,5	153,5	120,7	62,0	101,7	34,0
36-60	74,5	17,2	0,0	30,0	17,2	44,5	0,0
61-90	22,5	6,3	0,0	0,0	6,3	22,5	0,0
91-180	44,8	35,6	0,0	0,0	35,6	44,8	0,0
>180	24,2	33,4	5,0	0,0	10,4	6,2	18,0
<b>Total</b>	<b>545,3</b>	<b>460,8</b>	<b>247,2</b>	<b>177,0</b>	<b>134,7</b>	<b>289,2</b>	<b>79,0</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	-1,8 %	1,2 %	1,1 %	0,7 %
15-35	1,1 %	1,5 %	1,5 %	1,5 %
36-60	-	2,0 %	1,5 %	1,6 %
61-90	-	1,9 %	1,4 %	1,5 %
91-180	-	1,9 %	1,1 %	1,5 %
>180	1,5 %	2,0 %	1,2 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>0,2 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,3 %</b>	<b>1,3 %</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**

Sector	11 al 15 de Julio				18 al 22 de Julio				25 al 29 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	159	2237	2829	8	66	1934	2174	7	193	1801	1693
Intragrupa y off-shore***	0	0	1734	874	0	1	1451	821	0	0	769	730
Otros	159	11	730	997	66	6	398	789	192	7	537	684
<b>Total</b>	<b>170</b>	<b>170</b>	<b>4700</b>	<b>4700</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>3783</b>	<b>3783</b>	<b>200</b>	<b>200</b>	<b>3107</b>	<b>3107</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