

**Fecha de Publicación: 14 de Julio de 2011**  
**Fecha de Información: 12 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\$1126,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,4%.<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	137,1	67,8	33,1	62,0	2,7	43,1	32,0
15-35	249,6	404,6	198,0	118,9	90,6	14,7	116,0
36-60	46,0	22,4	0,0	0,0	22,4	46,0	0,0
61-90	10,8	27,8	25,0	0,0	2,8	10,8	0,0
91-180	11,0	84,0	40,0	1,0	39,0	5,0	5,0
>180	20,0	45,7	6,6	20,0	39,1	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>474,5</b>	<b>652,4</b>	<b>302,7</b>	<b>201,9</b>	<b>196,7</b>	<b>119,6</b>	<b>153,0</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1,2 %	1,1 %	0,4 %	0,7 %
15-35	1,4 %	1,8 %	1,2 %	1,5 %
36-60	-	1,9 %	1,4 %	1,6 %
61-90	-	0,8 %	1,6 %	1,1 %
91-180	0,8 %	1,6 %	1,1 %	1,5 %
>180	-	1,7 %	1,3 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>1,4 %</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**	12	156	2322	2867	8	66	1967	2195	7	194	1841	1735
Intragruppo y off-shore***	0	0	1757	929	0	1	1452	821	0	0	779	738
Otros	156	12	733	1016	65	6	399	802	194	7	551	698
<b>Total</b>	<b>168</b>	<b>168</b>	<b>4813</b>	<b>4813</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>3818</b>	<b>3818</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>3171</b>	<b>3171</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 intragruppo