

**Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2011**  
**Fecha de Información: 25 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\$1087,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,3%.<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	254,2	206,3	106,5	90,0	66,8	131,2	33,0
15-35	203,9	236,0	105,0	109,0	103,0	66,9	28,0
36-60	28,8	5,8	0,0	10,0	5,8	18,8	0,0
61-90	5,2	0,3	0,0	0,0	0,3	5,2	0,0
91-180	96,8	18,8	10,0	0,0	8,8	96,8	0,0
>180	25,1	6,5	0,0	15,0	6,5	10,1	0,0
<b>Total</b>	<b>614,0</b>	<b>473,7</b>	<b>221,5</b>	<b>224,0</b>	<b>191,2</b>	<b>329,0</b>	<b>61,0</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	5,0 %	3,6 %	0,4 %	2,1 %
15-35	2,5 %	2,8 %	2,2 %	2,5 %
36-60	-	2,4 %	1,9 %	2,0 %
61-90	-	2,6 %	1,8 %	1,8 %
91-180	-	2,1 %	2,1 %	2,1 %
>180	-	2,2 %	1,8 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>2,3 %</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	25 al 29 de Julio				1 al 5 de Agosto				8 al 12 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	192	2345	2414	6	201	1630	2020	7	144	2049	2057
Intragrupa y off-shore***	0	0	1135	821	0	0	1313	646	0	0	946	774
Otros	192	76	701	946	201	6	367	644	144	7	521	684
<b>Total</b>	<b>268</b>	<b>268</b>	<b>4181</b>	<b>4181</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>3311</b>	<b>3311</b>	<b>151</b>	<b>151</b>	<b>3516</b>	<b>3516</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