

Fecha de Publicación: 30 de Junio de 2011  
 Fecha de Información: 28 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\$1343,6 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	269,7	213,9	134,0	221,0	39,9	8,7	40,0
15-35	253,2	313,6	229,0	160,5	44,6	52,7	40,0
36-60	5,3	6,3	0,0	0,0	6,3	5,3	0,0
61-90	15,2	35,4	0,0	4,5	35,4	10,7	0,0
91-180	74,3	111,2	25,0	0,0	76,2	64,3	10,0
>180	30,7	14,9	0,0	30,0	14,9	0,7	0,0
<b>Total</b>	<b>648,4</b>	<b>695,3</b>	<b>388,0</b>	<b>416,0</b>	<b>217,3</b>	<b>142,4</b>	<b>90,0</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	0,7 %	1,0 %	0,7 %	0,8 %
15-35	2,1 %	2,6 %	0,8 %	1,8 %
36-60	-	1,9 %	0,9 %	1,4 %
61-90	-	1,7 %	1,3 %	1,6 %
91-180	0,8 %	1,5 %	1,1 %	1,3 %
>180	-	1,9 %	1,4 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>2,0 %</b>	<b>0,9 %</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**

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	391	2528	2447	7	168	1827	1786	3	157	1827	2111
Intragruppo y off-shore***	0	0	1243	1255	14	0	975	648	0	0	1444	722
Otros	391	17	753	823	154	7	454	821	157	3	417	855
<b>Total</b>	<b>408</b>	<b>408</b>	<b>4525</b>	<b>4525</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>3256</b>	<b>3256</b>	<b>160</b>	<b>160</b>	<b>3688</b>	<b>3688</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 intragruppo