

Fecha de Publicación: 07 de Febrero de 2011  
 Fecha de Información: 03 de Febrero 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\$1075,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,6%.<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	186,3	181,0	133,0	81,2	2,0	59,1	46,0
15-35	247,3	277,6	120,5	77,0	50,7	63,9	106,4
36-60	13,7	50,7	20,0	0,0	30,7	13,7	0,0
61-90	47,6	20,9	0,0	0,0	5,9	32,6	15,0
91-180	18,6	1,8	0,0	0,0	1,8	18,6	0,0
>180	19,1	11,1	0,0	5,0	11,1	14,1	0,0
<b>Total</b>	<b>532,6</b>	<b>543,1</b>	<b>273,5</b>	<b>163,2</b>	<b>102,2</b>	<b>202,0</b>	<b>167,4</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 %	-3,6 %	-2,4 %	-2,6 %
15-35	-1,6 %	-3,2 %	-4,7 %	-3,3 %
36-60	-	-1,1 %	-2,6 %	-1,4 %
61-90	-2,5 %	-0,3 %	-1,4 %	-1,6 %
91-180	-	1,5 %	-0,4 %	-0,3 %
>180	-	1,1 %	0,1 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>-1,7 %</b>	<b>-2,7 %</b>	<b>-2,9 %</b>	<b>-2,6 %</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	31 de Ene. al 4 de Febrero				7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	34	2261	2154	16	159	1804	2508	20	190	1429	1749
Intragrupa y off-shore***	0	0	1339	1277	0	1	1125	749	0	0	977	614
Otros	34	11	374	542	159	15	937	609	190	20	613	656
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>3973</b>	<b>3973</b>	<b>175</b>	<b>175</b>	<b>3866</b>	<b>3866</b>	<b>210</b>	<b>210</b>	<b>3018</b>	<b>3018</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