

**Fecha de Publicación: 01 de Marzo de 2011**  
**Fecha de Información: 25 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\$1157,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -3,0%.<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	180,4	110,4	92,0	144,0	4,4	22,4	14,0
15-35	320,9	384,4	160,0	115,1	140,4	121,8	84,0
36-60	0,5	5,8	0,0	0,0	5,8	0,5	0,0
61-90	24,3	4,8	0,0	0,0	4,8	24,3	0,0
91-180	36,7	36,3	10,0	5,0	16,3	21,7	10,0
>180	20,7	32,5	20,0	0,0	12,2	20,3	0,4
<b>Total</b>	<b>583,6</b>	<b>574,3</b>	<b>282,0</b>	<b>264,1</b>	<b>183,9</b>	<b>211,1</b>	<b>108,4</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	-4,6 %	-2,7 %	-1,6 %	-2,0 %
15-35	-3,4 %	-3,3 %	-4,4 %	-3,7 %
36-60	-	-3,0 %	-4,8 %	-3,1 %
61-90	-	-0,5 %	-2,7 %	-2,3 %
91-180	-2,5 %	-0,6 %	-2,7 %	-1,8 %
>180	0,0 %	0,2 %	-0,3 %	0,0 %
<b>Total</b>	<b>-3,5 %</b>	<b>-2,8 %</b>	<b>-3,1 %</b>	<b>-3,0 %</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	21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	53	2751	2835	10	79	2299	2572	8	193	1653	1642
Intragrupa y off-shore***	0	0	1794	1385	0	0	1592	1127	0	0	703	588
Otros	53	36	450	774	79	10	444	636	193	8	447	573
<b>Total</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4995</b>	<b>4995</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>4335</b>	<b>4335</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>2803</b>	<b>2803</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