

Fecha de Publicación: 19 de Marzo de 2011  
 Fecha de Información: 17 de Marzo 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\$988,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,5%.<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	133,4	266,8	146,8	39,0	52,0	26,4	68,0
15-35	102,4	174,2	115,4	58,5	33,8	18,9	25,0
36-60	73,0	17,9	0,0	0,0	7,9	63,0	10,0
61-90	47,4	45,1	0,0	0,0	44,9	47,3	0,1
91-180	51,3	47,9	8,0	10,0	32,9	34,3	7,0
>180	10,8	17,9	10,0	5,0	7,9	5,8	0,0
<b>Total</b>	<b>418,4</b>	<b>569,8</b>	<b>280,1</b>	<b>112,5</b>	<b>179,5</b>	<b>195,7</b>	<b>110,1</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	-1,0 %	-1,6 %	-0,1 %	-1,0 %
15-35	-1,0 %	-1,7 %	-1,7 %	-1,6 %
36-60	-2,0 %	-0,8 %	-3,3 %	-2,9 %
61-90	-1,2 %	-1,5 %	-2,5 %	-2,0 %
91-180	-1,7 %	-0,7 %	-2,0 %	-1,4 %
>180	-	0,4 %	-0,3 %	0,1 %
<b>Total</b>	<b>-1,2 %</b>	<b>-1,4 %</b>	<b>-1,8 %</b>	<b>-1,5 %</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	14 al 18 de Marzo				21 al 25 de Marzo				28 de Mar. al 1 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	160	2665	3031	12	160	1261	1650	8	419	1472	1590
Intragruppo y off-shore***	5	1	1886	1340	0	0	992	442	0	0	694	467
Otros	154	33	602	782	160	12	356	517	419	8	492	601
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>5153</b>	<b>5153</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>2609</b>	<b>2609</b>	<b>427</b>	<b>427</b>	<b>2658</b>	<b>2658</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo