

**Fecha de Publicación: 30 de Marzo de 2011**  
**Fecha de Información: 28 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\$1164,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,5%.<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	259,2	170,5	129,0	165,0	21,0	73,7	20,5
15-35	110,8	301,5	207,5	34,0	64,5	47,3	29,5
36-60	66,6	64,7	0,0	12,0	49,7	39,6	15,0
61-90	0,0	61,8	0,0	0,0	61,8	0,0	0,0
91-180	38,7	60,9	30,0	3,0	30,9	35,7	0,0
>180	6,2	23,9	10,0	0,0	13,9	6,2	0,0
<b>Total</b>	<b>481,5</b>	<b>683,3</b>	<b>376,5</b>	<b>214,0</b>	<b>241,8</b>	<b>202,5</b>	<b>65,0</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	-0,9 %	-0,8 %	-4,0 %	-3,3 %
15-35	-3,3 %	-2,8 %	-4,4 %	-3,2 %
36-60	-3,5 %	-2,8 %	-4,2 %	-3,5 %
61-90	-	-0,4 %	-5,7 %	-0,5 %
91-180	-	3,2 %	-1,7 %	1,3 %
>180	-	0,3 %	-0,1 %	0,2 %
<b>Total</b>	<b>-2,6 %</b>	<b>-1,4 %</b>	<b>-3,8 %</b>	<b>-2,5 %</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	28 de Mar. al 1 de Abril				4 al 8 de Abril				11 al 15 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	505	2165	2348	10	163	1910	1926	18	131	1814	1713
Intragrupa y off-shore***	0	0	1107	864	0	0	943	825	0	0	621	542
Otros	505	7	592	652	163	10	578	680	131	18	706	883
<b>Total</b>	<b>512</b>	<b>512</b>	<b>3864</b>	<b>3864</b>	<b>172</b>	<b>172</b>	<b>3431</b>	<b>3431</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>3141</b>	<b>3138</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