

**Fecha de Publicación: 01 de Abril de 2011**  
**Fecha de Información: 30 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\$1420,4 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	165,0	246,1	227,5	134,0	3,1	15,5	15,5
15-35	314,4	375,6	145,7	193,9	159,9	50,5	70,0
36-60	9,5	33,8	14,8	8,0	19,0	1,5	0,0
61-90	34,6	11,4	0,0	0,0	11,4	34,6	0,0
91-180	52,3	66,4	10,0	15,0	31,4	12,3	25,0
>180	70,3	41,0	10,0	40,0	18,0	17,3	13,0
<b>Total</b>	<b>646,0</b>	<b>774,3</b>	<b>408,0</b>	<b>390,9</b>	<b>242,9</b>	<b>131,6</b>	<b>123,5</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	7,2 %	-2,8 %	-6,0 %	-3,5 %
15-35	-5,3 %	-3,8 %	-3,9 %	-4,0 %
36-60	-	-2,6 %	-4,1 %	-2,9 %
61-90	-	-1,6 %	-2,8 %	-2,5 %
91-180	7,6 %	2,9 %	-2,5 %	2,6 %
>180	-0,9 %	0,2 %	-0,9 %	-0,6 %
<b>Total</b>	<b>-0,6 %</b>	<b>-2,7 %</b>	<b>-3,9 %</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	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**	8	496	2428	2432	7	175	2122	2240	18	134	1828	1753
Intragrupa y off-shore***	0	0	1198	1122	0	0	1215	943	0	0	634	542
Otros	496	8	579	651	175	7	585	740	134	18	733	897
<b>Total</b>	<b>505</b>	<b>505</b>	<b>4205</b>	<b>4205</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>3922</b>	<b>3922</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>3195</b>	<b>3192</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