

**Fecha de Publicación: 9 de Diciembre de 2010**  
**Fecha de Información: 06 de Diciembre de 2010 <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\$877,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -2,4%.<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	209,5	115,2	4,1	93,6	26,1	30,9	85,0
15-35	138,5	203,0	126,0	52,5	21,0	30,0	56,0
36-60	55,4	18,8	4,0	0,0	0,8	41,4	14,0
61-90	35,1	11,7	0,0	0,0	11,7	35,1	0,0
91-180	15,9	7,3	0,0	0,0	5,3	13,9	2,0
>180	43,2	23,5	10,0	5,0	13,5	38,2	0,0
<b>Total</b>	<b>497,8</b>	<b>379,5</b>	<b>144,1</b>	<b>151,1</b>	<b>78,4</b>	<b>189,7</b>	<b>157,0</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	-0,7 %	-6,8 %	-5,1 %	-3,1 %
15-35	1,6 %	-3,2 %	-5,7 %	-2,7 %
36-60	-2,4 %	-2,5 %	-3,1 %	-2,9 %
61-90	-	-0,1 %	-2,8 %	-2,1 %
91-180	-1,2 %	0,4 %	-1,0 %	-0,7 %
>180	-	0,3 %	0,1 %	0,1 %
<b>Total</b>	<b>0,0 %</b>	<b>-3,1 %</b>	<b>-3,5 %</b>	<b>-2,4 %</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	6 al 10 de Diciembre				13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	266	1771	1387	43	390	1772	2287	7	206	1040	1459
Intragrupa y off-shore***	0	2	740	734	0	0	1714	854	0	0	1049	586
Otros	266	34	333	723	390	43	227	572	206	7	214	257
<b>Total</b>	<b>302</b>	<b>302</b>	<b>2844</b>	<b>2844</b>	<b>433</b>	<b>433</b>	<b>3713</b>	<b>3713</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>2302</b>	<b>2302</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