

**Fecha de Publicación: 10 de Diciembre de 2010**  
**Fecha de Información: 07 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\$1201,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,8%.<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	332,7	225,2	173,2	263,2	18,0	35,4	34,0
15-35	85,7	206,5	63,0	39,0	110,5	13,7	33,0
36-60	23,1	131,0	70,0	0,0	61,0	23,1	0,0
61-90	35,4	6,6	0,0	0,0	6,6	35,4	0,0
91-180	54,0	17,1	0,0	15,0	17,1	39,0	0,0
>180	52,6	31,5	28,0	0,0	3,5	52,6	0,0
<b>Total</b>	<b>583,5</b>	<b>617,9</b>	<b>334,2</b>	<b>317,2</b>	<b>216,6</b>	<b>199,3</b>	<b>67,0</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	-11,3 %	-7,8 %	-6,6 %	-7,5 %
15-35	-3,4 %	-4,2 %	-6,2 %	-4,5 %
36-60	-	-5,1 %	-5,3 %	-5,1 %
61-90	-	0,2 %	-1,1 %	-0,9 %
91-180	-	0,0 %	-1,2 %	-0,9 %
>180	-	0,4 %	-0,7 %	-0,4 %
<b>Total</b>	<b>-7,4 %</b>	<b>-4,7 %</b>	<b>-4,4 %</b>	<b>-4,8 %</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	267	1780	1536	44	394	2043	2343	8	240	1108	1476
Intragrupa y off-shore***	0	2	885	738	3	0	1739	1088	0	0	1049	621
Otros	267	34	332	723	391	44	243	595	240	8	216	276
<b>Total</b>	<b>303</b>	<b>303</b>	<b>2997</b>	<b>2997</b>	<b>438</b>	<b>438</b>	<b>4026</b>	<b>4026</b>	<b>248</b>	<b>248</b>	<b>2373</b>	<b>2373</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 intragrupo