

**Fecha de Publicación: 21 de Diciembre de 2010**  
**Fecha de Información: 17 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\$681,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,8%.<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	152,7	38,9	5,0	111,5	18,9	26,2	15,0
15-35	137,4	207,6	130,6	71,0	48,0	37,4	29,0
36-60	1,8	38,6	25,0	0,0	13,6	1,8	0,0
61-90	2,9	12,9	10,0	0,0	2,9	2,9	0,0
91-180	4,9	8,3	0,0	0,0	8,3	4,9	0,0
>180	23,5	52,1	50,0	10,0	2,1	13,5	0,0
<b>Total</b>	<b>323,3</b>	<b>358,6</b>	<b>220,6</b>	<b>192,5</b>	<b>93,9</b>	<b>86,8</b>	<b>44,0</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	-6,9 %	-5,7 %	-7,3 %	-7,0 %
15-35	-0,8 %	-8,1 %	-10,8 %	-7,9 %
36-60	-	31,0 %	-11,0 %	26,0 %
61-90	-	-4,1 %	-6,3 %	-4,5 %
91-180	-	-1,7 %	-3,1 %	-2,2 %
>180	-	1,5 %	-1,7 %	-1,2 %
<b>Total</b>	<b>-2,9 %</b>	<b>-4,7 %</b>	<b>-7,9 %</b>	<b>-5,8 %</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	13 al 17 de Diciembre				20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	43	394	2537	2483	15	288	1569	1730	5	466	1810	1824
Intragrupa y off-shore***	3	0	1811	1476	0	0	1217	944	0	0	1114	1005
Otros	391	43	264	654	288	15	228	339	466	5	209	305
<b>Total</b>	<b>437</b>	<b>437</b>	<b>4612</b>	<b>4612</b>	<b>302</b>	<b>302</b>	<b>3013</b>	<b>3013</b>	<b>471</b>	<b>471</b>	<b>3134</b>	<b>3134</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