

**Fecha de Publicación: 5 de Enero de 2011**  
**Fecha de Información: 03 de Enero 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\$426,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -8,2%.<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	127,0	91,4	0,0	36,0	0,9	0,5	90,5
15-35	63,2	110,6	61,6	31,0	34,0	17,2	15,0
36-60	0,1	0,9	0,0	0,0	0,9	0,1	0,0
61-90	13,0	0,1	0,0	0,0	0,1	13,0	0,0
91-180	11,3	2,2	0,0	0,0	2,2	11,3	0,0
>180	6,9	0,0	0,0	0,0	0,0	6,9	0,0
<b>Total</b>	<b>221,5</b>	<b>205,2</b>	<b>61,6</b>	<b>67,0</b>	<b>38,0</b>	<b>49,0</b>	<b>105,5</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	-6,2 %	-0,3 %	-6,7 %	-6,3 %
15-35	-11,7 %	-9,9 %	-12,0 %	-10,8 %
36-60	-	-2,1 %	-12,3 %	-2,8 %
61-90	-	0,0 %	-5,4 %	-5,3 %
91-180	-	0,0 %	-6,5 %	-5,4 %
>180	-	-	-2,3 %	-2,3 %
<b>Total</b>	<b>-7,0 %</b>	<b>-9,5 %</b>	<b>-8,4 %</b>	<b>-8,2 %</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	3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	97	1395	1577	29	251	1135	1797	3	232	1115	1347
Intragrupa y off-shore***	0	0	788	581	0	0	1243	512	0	0	883	353
Otros	97	11	398	423	251	29	317	386	232	3	257	555
<b>Total</b>	<b>108</b>	<b>108</b>	<b>2581</b>	<b>2581</b>	<b>280</b>	<b>280</b>	<b>2695</b>	<b>2695</b>	<b>235</b>	<b>235</b>	<b>2255</b>	<b>2255</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