

**Fecha de Publicación: 13 de Enero de 2011**  
**Fecha de Información: 11 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\$1010,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -9,2%.<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	266,9	155,1	33,5	196,5	73,6	22,4	48,0
15-35	136,0	287,4	161,9	63,0	95,5	43,0	30,0
36-60	17,3	28,6	0,0	0,0	28,6	17,3	0,0
61-90	55,6	40,8	0,0	0,0	40,8	55,6	0,0
91-180	13,1	4,9	0,0	0,0	4,9	13,1	0,0
>180	1,5	3,5	0,0	0,0	3,5	1,5	0,0
<b>Total</b>	<b>490,5</b>	<b>520,1</b>	<b>195,4</b>	<b>259,5</b>	<b>246,7</b>	<b>153,0</b>	<b>78,0</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	-9,1 %	-5,5 %	-18,8 %	-13,8 %
15-35	-6,7 %	-7,4 %	-8,4 %	-7,6 %
36-60	-	-3,6 %	-5,8 %	-4,4 %
61-90	-	-1,5 %	-2,3 %	-2,0 %
91-180	-	0,9 %	-2,5 %	-1,6 %
>180	-	1,4 %	-1,5 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>-8,2 %</b>	<b>-6,0 %</b>	<b>-12,9 %</b>	<b>-9,2 %</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	10 al 14 de Enero				17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	134	2057	2015	3	240	1377	1564	7	201	960	1071
Intragrupa y off-shore***	0	1	1290	1347	0	0	956	480	0	0	640	206
Otros	134	35	436	421	240	3	330	620	201	7	253	575
<b>Total</b>	<b>171</b>	<b>171</b>	<b>3783</b>	<b>3783</b>	<b>243</b>	<b>243</b>	<b>2663</b>	<b>2663</b>	<b>207</b>	<b>207</b>	<b>1852</b>	<b>1852</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