

**Fecha de Publicación: 21 de Enero de 2011**  
**Fecha de Información: 19 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\$960,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -5,0%.<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	168,4	42,1	5,0	106,5	22,1	46,9	15,0
15-35	232,3	212,1	131,1	142,1	76,0	85,2	5,0
36-60	44,1	31,9	5,1	40,0	26,9	4,1	0,0
61-90	30,2	31,1	5,1	20,0	26,0	10,2	0,0
91-180	31,0	37,5	0,0	19,0	37,5	12,0	0,0
>180	3,6	96,0	80,0	0,0	16,0	3,6	0,0
<b>Total</b>	<b>509,6</b>	<b>450,6</b>	<b>226,2</b>	<b>327,6</b>	<b>204,5</b>	<b>162,0</b>	<b>20,0</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	-13,0 %	-4,1 %	-4,7 %	-5,3 %
15-35	-7,5 %	-6,2 %	-7,3 %	-6,7 %
36-60	-	-3,1 %	-3,2 %	-3,2 %
61-90	-	-2,2 %	-3,2 %	-2,7 %
91-180	-	-1,0 %	-1,3 %	-1,1 %
>180	-	0,6 %	-0,7 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>-11,7 %</b>	<b>-4,2 %</b>	<b>-5,3 %</b>	<b>-5,0 %</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	17 al 21 de Enero				24 al 28 de Enero				31 de Ene. al 4 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	114	1803	1805	7	205	1142	1259	4	139	725	1335
Intragrupa y off-shore***	0	0	1015	793	0	0	715	295	0	0	923	171
Otros	114	5	442	662	205	7	321	625	139	4	245	387
<b>Total</b>	<b>119</b>	<b>119</b>	<b>3259</b>	<b>3259</b>	<b>212</b>	<b>212</b>	<b>2178</b>	<b>2178</b>	<b>143</b>	<b>143</b>	<b>1893</b>	<b>1893</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