

**Fecha de Publicación: 09 de Febrero de 2011**  
**Fecha de Información: 07 de Febrero 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\$656,7 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	124,7	67,2	47,0	100,5	7,2	11,2	13,0
15-35	124,3	220,7	128,5	65,0	71,3	38,3	21,0
36-60	6,2	6,6	0,0	3,0	6,6	3,2	0,0
61-90	0,7	3,2	0,0	0,0	3,2	0,7	0,0
91-180	19,0	19,7	0,0	5,0	19,7	14,0	0,0
>180	18,2	46,1	30,0	0,0	16,1	18,2	0,0
<b>Total</b>	<b>293,1</b>	<b>363,6</b>	<b>205,5</b>	<b>173,5</b>	<b>124,1</b>	<b>85,6</b>	<b>34,0</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	0,0 %	-4,2 %	-7,7 %	-6,1 %
15-35	-6,7 %	-5,9 %	-6,9 %	-6,3 %
36-60	-	-3,1 %	-3,6 %	-3,3 %
61-90	-	-1,9 %	-3,7 %	-2,2 %
91-180	-	0,5 %	-1,1 %	-0,3 %
>180	-	0,4 %	-0,1 %	0,3 %
<b>Total</b>	<b>-4,1 %</b>	<b>-4,1 %</b>	<b>-6,3 %</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	7 al 11 de Febrero				14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	112	2106	2685	24	190	1471	1794	7	147	1959	1927
Intragrupa y off-shore***	0	1	1237	976	0	0	1022	631	0	0	1212	1076
Otros	112	16	980	661	190	24	613	681	147	7	321	488
<b>Total</b>	<b>129</b>	<b>129</b>	<b>4322</b>	<b>4322</b>	<b>214</b>	<b>214</b>	<b>3106</b>	<b>3106</b>	<b>154</b>	<b>154</b>	<b>3491</b>	<b>3491</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