

**Fecha de Publicación: 18 de Febrero de 2011**  
**Fecha de Información: 16 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\$1096,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -4,3%.<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	199,8	186,7	101,7	66,0	4,0	52,8	81,0
15-35	188,7	322,2	155,6	53,0	123,6	92,7	43,0
36-60	1,4	21,8	0,0	0,0	21,8	1,4	0,0
61-90	14,7	18,3	10,0	0,0	8,3	14,7	0,0
91-180	13,7	2,4	0,0	0,0	2,4	13,7	0,0
>180	77,6	49,6	30,0	10,0	9,6	57,6	10,0
<b>Total</b>	<b>495,9</b>	<b>601,0</b>	<b>297,3</b>	<b>129,0</b>	<b>169,7</b>	<b>232,9</b>	<b>134,0</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	-3,3 %	-5,2 %	-2,0 %	-3,2 %
15-35	-3,1 %	-5,1 %	-8,8 %	-6,1 %
36-60	-	-4,8 %	-6,7 %	-4,9 %
61-90	-	-2,5 %	-4,2 %	-3,3 %
91-180	-	1,3 %	-4,0 %	-3,2 %
>180	0,1 %	0,5 %	-1,0 %	-0,4 %
<b>Total</b>	<b>-3,0 %</b>	<b>-4,4 %</b>	<b>-4,8 %</b>	<b>-4,3 %</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	14 al 18 de Febrero				21 al 25 de Febrero				28 de Feb. al 4 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	27	95	2244	2255	9	147	2289	2442	7	87	1555	2136
Intragrupa y off-shore***	7	0	1205	1022	0	0	1585	1123	0	0	1395	692
Otros	87	27	768	940	147	9	345	653	87	7	356	478
<b>Total</b>	<b>122</b>	<b>122</b>	<b>4217</b>	<b>4217</b>	<b>157</b>	<b>157</b>	<b>4218</b>	<b>4218</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>3306</b>	<b>3306</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