

**Fecha de Publicación: 02 de Marzo de 2011**  
**Fecha de Información: 28 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\$699,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -6,2%.<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	82,3	101,2	61,0	48,0	20,2	14,3	20,0
15-35	114,0	213,2	110,0	26,0	68,2	53,0	35,0
36-60	18,6	34,1	5,0	0,0	29,1	18,6	0,0
61-90	20,8	39,7	0,0	0,0	19,7	0,8	20,0
91-180	16,4	33,2	10,0	3,0	13,2	3,4	10,0
>180	16,1	9,5	0,0	5,0	9,5	11,1	0,0
<b>Total</b>	<b>268,3</b>	<b>430,9</b>	<b>186,0</b>	<b>82,0</b>	<b>159,9</b>	<b>101,3</b>	<b>85,0</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 %	-4,4 %	-8,5 %	-5,9 %
15-35	-6,3 %	-8,1 %	-8,8 %	-8,0 %
36-60	-	-5,3 %	-6,4 %	-5,7 %
61-90	-2,7 %	-1,5 %	-6,0 %	-2,1 %
91-180	-3,5 %	-0,9 %	-4,1 %	-2,1 %
>180	-	0,6 %	-0,3 %	0,0 %
<b>Total</b>	<b>-3,6 %</b>	<b>-6,1 %</b>	<b>-7,5 %</b>	<b>-6,2 %</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	28 de Feb. al 4 de Marzo				7 al 11 de Marzo				14 al 18 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	64	2361	2650	8	195	1673	1669	14	259	1687	1891
Intragrupa y off-shore***	0	0	1642	1164	0	0	714	599	0	0	1000	878
Otros	64	10	451	641	195	8	463	581	259	14	547	465
<b>Total</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>4455</b>	<b>4455</b>	<b>203</b>	<b>203</b>	<b>2850</b>	<b>2850</b>	<b>273</b>	<b>273</b>	<b>3234</b>	<b>3234</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