

**Fecha de Publicación: 28 de Diciembre de 2010**  
**Fecha de Información: 24 de Diciembre de 2010 <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\$101,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -14,4%.<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	36,2	0,8	0,8	33,0	0,0	3,2	0,0
15-35	34,0	22,0	19,0	25,3	0,0	5,7	3,0
36-60	2,9	0,0	0,0	0,0	0,0	2,9	0,0
61-90	0,2	0,2	0,0	0,0	0,2	0,2	0,0
91-180	0,6	2,4	0,0	0,0	2,4	0,6	0,0
>180	2,5	0,0	0,0	0,0	0,0	2,5	0,0
<b>Total</b>	<b>76,5</b>	<b>25,4</b>	<b>19,8</b>	<b>58,3</b>	<b>2,7</b>	<b>15,2</b>	<b>3,0</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	-	-15,0 %	-13,5 %	-13,5 %
15-35	-17,2 %	-15,7 %	-16,8 %	-16,4 %
36-60	-	-	-13,3 %	-13,3 %
61-90	-	-2,2 %	-9,3 %	-6,2 %
91-180	-	-2,3 %	-5,2 %	-2,9 %
>180	-	-	-2,1 %	-2,1 %
<b>Total</b>	<b>-17,2 %</b>	<b>-14,2 %</b>	<b>-14,4 %</b>	<b>-14,4 %</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	20 al 24 de Diciembre				27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	300	1744	1720	6	467	2027	1954	11	126	1043	1348
Intragrupa y off-shore***	0	0	1217	1108	0	0	1176	1158	0	0	761	465
Otros	300	15	218	350	467	6	264	355	126	11	344	335
<b>Total</b>	<b>315</b>	<b>315</b>	<b>3178</b>	<b>3178</b>	<b>473</b>	<b>473</b>	<b>3466</b>	<b>3466</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>2149</b>	<b>2149</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo