

**Fecha de Publicación: 4 de Enero de 2011**  
**Fecha de Información: 30 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\$368,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -11%.<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	35,7	22,5	10,5	14,0	6,0	15,7	6,0
15-35	60,4	209,6	149,0	0,0	19,6	19,4	41,0
36-60	1,9	7,1	0,0	0,0	7,1	1,9	0,0
61-90	1,4	5,2	4,0	0,0	1,2	1,4	0,0
91-180	5,7	18,7	0,0	0,0	18,7	5,7	0,0
>180	0,0	0,1	0,0	0,0	0,1	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>105,1</b>	<b>263,1</b>	<b>163,5</b>	<b>14,0</b>	<b>52,6</b>	<b>44,1</b>	<b>47,0</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	-0,1 %	-13,1 %	-17,1 %	-13,9 %
15-35	-2,8 %	-12,7 %	-20,6 %	-11,1 %
36-60	-	-5,5 %	-20,0 %	-8,5 %
61-90	-	-5,1 %	-7,6 %	-5,6 %
91-180	-	-2,0 %	-15,0 %	-5,1 %
>180	-	0,2 %	-	0,2 %
<b>Total</b>	<b>-2,5 %</b>	<b>-10,7 %</b>	<b>-17,9 %</b>	<b>-10,8 %</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	27 al 31 de Diciembre				3 al 7 de Enero				10 al 14 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	452	2178	2145	11	126	1268	1461	29	251	1135	1796
Intragrupa y off-shore***	0	0	1286	1202	0	0	788	545	0	0	1243	512
Otros	452	6	268	385	126	11	373	423	251	29	316	386
<b>Total</b>	<b>457</b>	<b>457</b>	<b>3732</b>	<b>3732</b>	<b>137</b>	<b>137</b>	<b>2429</b>	<b>2429</b>	<b>280</b>	<b>280</b>	<b>2694</b>	<b>2694</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo