

Fecha de Publicación: 02 de Noviembre de 2010

Fecha de Información: 28 de Octubre 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\$1160,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,2%.<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	108,0	94,2	35,0	75,0	59,2	33,0	0,0
15-35	404,8	376,1	275,3	46,8	24,8	282,0	76,0
36-60	30,7	6,0	0,0	0,0	6,0	30,7	0,0
61-90	38,9	29,2	0,0	0,0	29,2	38,9	0,0
91-180	41,1	16,9	10,0	0,0	6,9	41,1	0,0
>180	13,1	1,3	0,0	0,0	1,3	13,1	0,0
<b>Total</b>	<b>636,6</b>	<b>523,6</b>	<b>320,3</b>	<b>121,8</b>	<b>127,3</b>	<b>438,9</b>	<b>76,0</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	-	-0,2 %	-0,2 %	-0,2 %
15-35	0,0 %	0,0 %	-0,6 %	-0,3 %
36-60	-	0,8 %	-0,8 %	-0,5 %
61-90	-	0,3 %	-0,2 %	0,0 %
91-180	-	0,4 %	0,2 %	0,2 %
>180	-	2,1 %	0,9 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>-0,2 %</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	25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	353	2462	2010	14	172	1882	1754	12	140	1345	1335
Intragrupa y off-shore***	0	0	1092	1093	0	0	985	723	0	0	808	393
Otros	353	31	432	883	172	14	301	692	140	12	280	705
<b>Total</b>	<b>384</b>	<b>384</b>	<b>3985</b>	<b>3985</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>3169</b>	<b>3169</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>2433</b>	<b>2433</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