

**Fecha de Publicación: 8 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 04 de Noviembre 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\$1382,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,1%.<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	243,3	106,7	23,0	160,0	49,7	49,3	34,0
15-35	353,6	281,3	172,5	262,0	49,8	32,6	59,0
36-60	9,2	171,9	149,0	0,0	22,9	9,2	0,0
61-90	51,0	44,7	30,0	0,0	14,7	51,0	0,0
91-180	67,1	11,8	5,0	0,0	6,8	67,1	0,0
>180	2,9	39,0	33,0	0,0	6,0	2,9	0,0
<b>Total</b>	<b>727,1</b>	<b>655,4</b>	<b>412,5</b>	<b>422,0</b>	<b>149,9</b>	<b>212,1</b>	<b>93,0</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 %	1,9 %	-1,1 %	-0,2 %
15-35	0,8 %	-0,1 %	-0,2 %	-0,1 %
36-60	-	-0,1 %	-1,2 %	-0,1 %
61-90	-	0,1 %	-0,4 %	-0,2 %
91-180	-	0,5 %	0,1 %	0,1 %
>180	-	1,0 %	1,0 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,2 %</b>	<b>-0,5 %</b>	<b>-0,1 %</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	1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	164	2205	1865	23	164	1720	1457	17	177	1282	1559
Intragrupa y off-shore***	0	0	1005	1005	0	0	834	619	0	0	1077	387
Otros	164	18	363	703	163	23	332	811	177	17	170	583
<b>Total</b>	<b>182</b>	<b>182</b>	<b>3573</b>	<b>3573</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>2886</b>	<b>2886</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>2529</b>	<b>2529</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