

**Fecha de Publicación: 16 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 11 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\$627,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,6%.<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	80,0	106,4	25,0	18,0	34,4	15,0	47,0
15-35	121,3	198,7	97,5	75,5	85,2	29,8	16,0
36-60	3,1	36,3	0,0	0,0	36,3	3,1	0,0
61-90	15,5	13,8	0,0	0,0	13,8	15,5	0,0
91-180	26,0	7,8	0,0	0,0	7,8	26,0	0,0
>180	19,0	0,1	0,0	0,0	0,1	19,0	0,0
<b>Total</b>	<b>264,8</b>	<b>363,0</b>	<b>122,5</b>	<b>93,5</b>	<b>177,5</b>	<b>108,3</b>	<b>63,0</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	-0,5 %	-1,0 %	-1,4 %	-0,9 %
15-35	-1,2 %	-0,7 %	-0,7 %	-0,7 %
36-60	-	-0,1 %	-2,7 %	-0,3 %
61-90	-	0,1 %	-1,1 %	-0,6 %
91-180	-	1,3 %	-0,2 %	0,2 %
>180	-	2,0 %	0,5 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>-0,7 %</b>	<b>-0,6 %</b>	<b>-0,7 %</b>	<b>-0,6 %</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	8 al 12 de Noviembre				15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	138	1944	1538	41	177	1621	1659	14	184	1799	1705
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	762	0	0	1084	536	0	0	1074	452
Otros	138	29	393	871	177	41	233	743	184	14	221	937
<b>Total</b>	<b>167</b>	<b>167</b>	<b>3170</b>	<b>3170</b>	<b>218</b>	<b>218</b>	<b>2938</b>	<b>2938</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>3094</b>	<b>3094</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