

**Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 12 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\$865,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,7%.<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	92,1	79,1	27,0	30,0	52,1	62,1	0,0
15-35	236,1	188,0	100,5	126,0	74,5	97,1	13,0
36-60	7,2	24,8	0,0	0,5	24,8	6,7	0,0
61-90	13,2	102,2	0,0	0,0	102,2	13,2	0,0
91-180	56,4	37,7	10,0	5,0	17,7	41,4	10,0
>180	17,5	11,1	10,0	0,0	1,1	17,5	0,0
<b>Total</b>	<b>422,5</b>	<b>442,9</b>	<b>147,5</b>	<b>161,5</b>	<b>272,4</b>	<b>238,0</b>	<b>23,0</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	-	-1,6 %	-2,1 %	-1,9 %
15-35	-0,3 %	-1,1 %	-3,8 %	-2,6 %
36-60	-	-1,2 %	-1,7 %	-1,3 %
61-90	-	-0,7 %	-1,2 %	-0,8 %
91-180	-0,3 %	0,1 %	-0,2 %	-0,1 %
>180	-	0,1 %	0,8 %	0,5 %
<b>Total</b>	<b>-0,3 %</b>	<b>-1,0 %</b>	<b>-2,6 %</b>	<b>-1,7 %</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**	28	138	1943	1538	46	177	1694	1729	14	184	1815	1714
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	762	0	0	1108	560	0	0	1077	458
Otros	138	28	394	871	177	46	279	792	184	14	227	947
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>3171</b>	<b>3171</b>	<b>223</b>	<b>223</b>	<b>3081</b>	<b>3081</b>	<b>198</b>	<b>198</b>	<b>3119</b>	<b>3119</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