

**Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 22 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\$946,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,4%.<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	253,8	68,7	1,0	236,0	57,7	7,8	10,0
15-35	136,6	324,9	264,0	92,0	35,9	19,6	25,0
36-60	13,6	10,4	0,0	0,0	10,4	13,6	0,0
61-90	13,7	2,9	0,0	0,0	2,9	13,7	0,0
91-180	107,4	4,8	0,0	0,0	4,8	107,4	0,0
>180	9,3	0,6	0,0	0,0	0,6	9,3	0,0
<b>Total</b>	<b>534,4</b>	<b>412,3</b>	<b>265,0</b>	<b>328,0</b>	<b>112,3</b>	<b>171,4</b>	<b>35,0</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 %	-0,9 %	-0,3 %	-0,4 %
15-35	-2,2 %	0,7 %	-2,7 %	-0,3 %
36-60	-	-1,7 %	-1,9 %	-1,8 %
61-90	-	0,1 %	-1,1 %	-0,9 %
91-180	-	-0,4 %	-0,4 %	-0,4 %
>180	-	2,1 %	0,1 %	0,2 %
<b>Total</b>	<b>-1,5 %</b>	<b>0,4 %</b>	<b>-0,9 %</b>	<b>-0,4 %</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	22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre				6 al 10 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	29	187	2344	1964	20	273	1957	1978	7	260	1398	964
Intragrupa y off-shore***	0	1	1145	890	0	0	1303	632	0	0	591	608
Otros	187	28	394	1029	273	20	354	1004	260	7	174	592
<b>Total</b>	<b>216</b>	<b>216</b>	<b>3883</b>	<b>3883</b>	<b>293</b>	<b>293</b>	<b>3614</b>	<b>3614</b>	<b>267</b>	<b>267</b>	<b>2163</b>	<b>2163</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