

**Fecha de Publicación: 3 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 29 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\$1080,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.<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	106,8	80,2	2,5	54,8	60,7	35,0	17,0
15-35	186,0	409,7	257,8	58,8	88,9	64,2	63,0
36-60	4,4	30,0	16,0	0,4	14,0	4,0	0,0
61-90	23,2	12,5	0,0	0,0	12,5	23,2	0,0
91-180	120,8	86,3	0,0	0,0	86,3	120,8	0,0
>180	15,1	5,4	0,0	0,0	5,4	15,1	0,0
<b>Total</b>	<b>456,3</b>	<b>624,2</b>	<b>276,3</b>	<b>114,0</b>	<b>267,9</b>	<b>262,3</b>	<b>80,0</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	-0,1 %	0,1 %	-0,2 %	-0,1 %
15-35	-0,2 %	0,2 %	-0,5 %	0,0 %
36-60	-	4,8 %	-1,2 %	4,1 %
61-90	-	0,9 %	-0,7 %	-0,2 %
91-180	-	6,8 %	0,1 %	2,9 %
>180	-	1,4 %	0,3 %	0,6 %
<b>Total</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>0,7 %</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	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	348	2463	2010	15	173	1951	1823	16	140	1379	1346
Intragrupa y off-shore***	0	0	1092	1093	0	0	985	776	0	0	810	395
Otros	348	31	432	884	173	15	356	694	140	16	286	733
<b>Total</b>	<b>379</b>	<b>379</b>	<b>3986</b>	<b>3986</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>3293</b>	<b>3293</b>	<b>155</b>	<b>155</b>	<b>2474</b>	<b>2474</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