

**Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 08 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\$574,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1,3%.<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	127,6	25,6	0,0	77,0	25,6	50,6	0,0
15-35	219,6	64,4	40,5	112,5	9,9	93,1	14,0
36-60	2,9	13,9	7,0	0,0	6,9	2,9	0,0
61-90	4,3	1,0	0,1	0,0	0,9	4,3	0,0
91-180	68,8	41,8	20,0	0,0	12,4	59,3	9,5
>180	1,7	3,2	0,0	0,0	3,2	1,7	0,0
<b>Total</b>	<b>425,0</b>	<b>149,9</b>	<b>67,6</b>	<b>189,5</b>	<b>58,9</b>	<b>212,0</b>	<b>23,5</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 %	-2,4 %	-1,8 %
15-35	-0,6 %	-1,2 %	-1,7 %	-1,6 %
36-60	-	-0,6 %	-1,8 %	-0,8 %
61-90	-	1,2 %	-0,2 %	0,1 %
91-180	-1,2 %	1,3 %	0,0 %	0,0 %
>180	-	1,2 %	0,0 %	0,8 %
<b>Total</b>	<b>-0,8 %</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>-1,5 %</b>	<b>-1,3 %</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	136	1897	1511	25	180	1340	1590	11	184	1622	1580
Intragrupa y off-shore***	0	0	834	732	0	0	1077	393	0	0	1045	431
Otros	136	29	386	874	180	25	201	635	184	11	183	838
<b>Total</b>	<b>165</b>	<b>165</b>	<b>3117</b>	<b>3117</b>	<b>205</b>	<b>205</b>	<b>2618</b>	<b>2618</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>2849</b>	<b>2849</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