

**Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2010**  
**Fecha de Información: 19 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\$469,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -1.5%.<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	55,8	23,3	0,0	0,0	23,3	55,8	0,0
15-35	179,2	85,6	23,0	99,0	23,6	41,2	39,0
36-60	1,7	6,1	0,0	0,0	6,1	1,7	0,0
61-90	25,4	20,5	0,0	0,0	20,5	25,4	0,0
91-180	24,5	15,3	0,0	0,7	15,3	23,8	0,0
>180	4,3	27,6	25,0	0,0	2,6	4,3	0,0
<b>Total</b>	<b>290,8</b>	<b>178,4</b>	<b>48,0</b>	<b>99,7</b>	<b>91,4</b>	<b>152,2</b>	<b>39,0</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	-	-1,2 %	-2,7 %	-2,3 %
15-35	-1,4 %	-1,3 %	-2,3 %	-2,0 %
36-60	-	0,2 %	-2,1 %	-0,3 %
61-90	-	-0,6 %	-1,5 %	-1,1 %
91-180	-	1,0 %	-0,5 %	0,1 %
>180	-	1,0 %	0,4 %	0,9 %
<b>Total</b>	<b>-1,4 %</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>-2,1 %</b>	<b>-1,5 %</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	15 al 19 de Noviembre				22 al 26 de Noviembre				29 de Nov. al 3 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	168	2038	1821	29	185	2145	1945	17	273	1905	1929
Intragrupa y off-shore***	0	0	1183	898	0	1	1145	690	0	0	1302	596
Otros	168	44	296	798	185	28	376	1030	273	17	317	998
<b>Total</b>	<b>213</b>	<b>213</b>	<b>3517</b>	<b>3517</b>	<b>215</b>	<b>215</b>	<b>3665</b>	<b>3665</b>	<b>290</b>	<b>290</b>	<b>3523</b>	<b>3523</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