

**Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2010**  
**Fecha de Información: 27 de Septiembre 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\$1010,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	214,8	130,5	19,0	45,0	6,5	64,8	105,0
15-35	233,2	216,6	96,4	63,8	14,2	63,4	106,0
36-60	26,7	16,5	0,0	15,0	16,5	11,7	0,0
61-90	64,7	41,5	10,0	0,0	31,5	64,7	0,0
91-180	28,2	26,2	0,0	0,0	26,2	28,2	0,0
>180	5,1	6,6	0,0	5,0	6,6	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>572,6</b>	<b>438,0</b>	<b>125,4</b>	<b>128,8</b>	<b>101,6</b>	<b>232,8</b>	<b>211,0</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 %	7,3 %	0,6 %	0,7 %
15-35	4,1 %	0,6 %	0,6 %	1,7 %
36-60	-	0,9 %	0,3 %	0,6 %
61-90	-	0,4 %	0,3 %	0,3 %
91-180	-	0,7 %	0,5 %	0,6 %
>180	-	3,9 %	1,5 %	2,8 %
<b>Total</b>	<b>2,1 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>1,1 %</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	27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	377	2277	2042	8	200	1858	1704	12	163	1689	1441
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1100	695	0	0	1014	607	0	0	964	749
<b>Otros</b>	377	11	582	1222	200	8	269	831	163	12	160	624
<b>Total</b>	<b>388</b>	<b>388</b>	<b>3959</b>	<b>3959</b>	<b>208</b>	<b>208</b>	<b>3142</b>	<b>3142</b>	<b>174</b>	<b>174</b>	<b>2813</b>	<b>2813</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