

Fecha de Publicación: 27 de Septiembre de 2010  
 Fecha de Información: 23 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\$1009,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<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	96,5	45,1	16,5	0,0	8,6	76,5	20,0
15-35	286,1	359,0	228,8	143,4	41,2	53,7	89,0
36-60	11,2	8,5	5,6	0,0	3,0	11,2	0,0
61-90	53,4	5,2	0,0	10,0	5,2	43,4	0,0
91-180	42,6	65,7	40,0	0,0	20,7	37,6	5,0
>180	19,2	17,0	0,0	0,0	2,0	4,2	15,0
<b>Total</b>	<b>509,0</b>	<b>500,5</b>	<b>290,9</b>	<b>153,4</b>	<b>80,7</b>	<b>226,6</b>	<b>129,0</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 %	0,6 %	0,3 %	0,3 %
15-35	2,4 %	1,3 %	0,1 %	1,1 %
36-60	-	0,6 %	0,3 %	0,5 %
61-90	-	0,9 %	0,3 %	0,4 %
91-180	0,4 %	0,8 %	0,5 %	0,7 %
>180	1,3 %	2,2 %	1,9 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>1,8 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,8 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	20 al 24 de Septiembre				27 de Sep. al 1 de Octubre				4 al 8 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	155	2171	1821	10	376	2114	1954	6	200	1727	1634
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1124	982	0	0	1086	632	0	0	996	558
<b>Otros</b>	155	12	411	903	376	10	552	1167	200	6	278	808
<b>Total</b>	<b>166</b>	<b>166</b>	<b>3706</b>	<b>3706</b>	<b>386</b>	<b>386</b>	<b>3752</b>	<b>3752</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>3000</b>	<b>3000</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.