

**Fecha de Publicación: 7 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 05 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\$1052,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	71,0	108,9	101,0	50,7	7,9	20,3	0,0
15-35	256,8	374,8	316,0	134,0	41,8	105,8	17,0
36-60	52,5	3,1	0,0	0,0	3,1	52,5	0,0
61-90	39,7	2,8	0,0	0,0	2,8	39,7	0,0
91-180	80,5	32,1	0,0	20,0	7,1	35,5	25,0
>180	21,3	8,7	0,0	16,0	3,7	0,3	5,0
<b>Total</b>	<b>521,8</b>	<b>530,5</b>	<b>417,0</b>	<b>220,7</b>	<b>66,5</b>	<b>254,1</b>	<b>47,0</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	-	0,4 %	6,3 %	2,4 %
15-35	0,0 %	1,4 %	-0,1 %	0,8 %
36-60	-	0,5 %	0,0 %	0,0 %
61-90	-	0,6 %	0,0 %	0,0 %
91-180	0,3 %	1,6 %	0,2 %	0,3 %
>180	1,7 %	1,9 %	1,1 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>0,4 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,9 %</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	4 al 8 de Octubre				11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	199	2129	1861	20	164	1819	1535	11	234	1158	1182
Intragrupa y off-shore***	0	0	1104	743	0	1	1014	764	0	0	834	338
Otros	199	19	312	942	164	19	194	728	234	11	152	624
<b>Total</b>	<b>219</b>	<b>219</b>	<b>3545</b>	<b>3545</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>3027</b>	<b>3027</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>2144</b>	<b>2144</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