

**Fecha de Publicación: 11 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 07 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\$1179,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.<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	100,1	105,7	29,5	26,0	76,2	74,1	0,0
15-35	225,9	334,0	239,3	67,5	42,0	105,7	52,7
36-60	57,5	46,9	0,0	0,0	46,9	57,5	0,0
61-90	109,2	70,2	13,0	0,0	54,2	106,2	3,0
91-180	42,2	48,4	5,0	0,0	43,4	42,2	0,0
>180	10,5	29,0	0,0	0,0	19,0	0,5	10,0
<b>Total</b>	<b>545,5</b>	<b>634,1</b>	<b>286,8</b>	<b>93,5</b>	<b>281,7</b>	<b>386,3</b>	<b>65,7</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 %	-1,3 %	-0,6 %
15-35	1,0 %	0,9 %	-0,4 %	0,4 %
36-60	-	0,3 %	-0,1 %	0,1 %
61-90	0,0 %	2,6 %	-0,1 %	1,0 %
91-180	-	2,2 %	0,1 %	1,2 %
>180	1,5 %	1,4 %	1,0 %	1,5 %
<b>Total</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>0,4 %</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	198	2149	1896	20	165	2043	1626	11	234	1175	1265
Intragrupa y off-shore***	0	0	1138	762	0	1	1041	889	0	0	836	338
Otros	198	19	313	942	165	19	257	828	234	11	229	635
<b>Total</b>	<b>217</b>	<b>217</b>	<b>3600</b>	<b>3600</b>	<b>185</b>	<b>185</b>	<b>3342</b>	<b>3342</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>2239</b>	<b>2239</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