

**Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 11 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\$349,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.<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	75,6	91,6	0,0	20,0	41,6	5,6	50,0
15-35	61,5	60,5	20,0	26,4	10,5	5,1	30,0
36-60	1,6	1,8	0,0	0,0	1,8	1,6	0,0
61-90	1,4	4,1	0,0	0,0	4,1	1,4	0,0
91-180	46,2	1,5	0,0	0,0	1,5	46,2	0,0
>180	2,1	2,0	0,0	0,0	2,0	2,1	0,0
<b>Total</b>	<b>188,4</b>	<b>161,5</b>	<b>20,0</b>	<b>46,4</b>	<b>61,5</b>	<b>62,0</b>	<b>80,0</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	2,3 %	0,0 %	0,3 %	1,1 %
15-35	0,1 %	0,5 %	-0,2 %	0,1 %
36-60	-	1,3 %	-0,6 %	0,4 %
61-90	-	1,1 %	-0,1 %	0,8 %
91-180	-	1,0 %	0,0 %	0,1 %
>180	-	1,6 %	0,4 %	1,0 %
<b>Total</b>	<b>1,5 %</b>	<b>0,4 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,6 %</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	11 al 15 de Octubre				18 al 22 de Octubre				25 al 29 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	165	2117	1704	13	235	1227	1367	13	353	1995	1380
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	1	1061	939	0	0	864	338	4	0	814	854
<b>Otros</b>	165	21	296	832	234	13	257	643	349	13	197	771
<b>Total</b>	<b>187</b>	<b>187</b>	<b>3475</b>	<b>3475</b>	<b>247</b>	<b>247</b>	<b>2349</b>	<b>2349</b>	<b>366</b>	<b>366</b>	<b>3005</b>	<b>3005</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