

**Fecha de Publicación: 14 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 12 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\$953,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.<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	157,0	82,7	57,0	115,0	15,7	32,0	10,0
15-35	217,0	185,1	96,9	91,0	0,7	38,5	87,5
36-60	21,7	32,7	20,0	0,4	2,7	11,3	10,0
61-90	105,4	38,8	0,0	0,0	38,8	105,4	0,0
91-180	82,9	23,8	10,0	0,0	3,8	72,9	10,0
>180	4,6	2,0	0,0	0,0	2,0	4,6	0,0
<b>Total</b>	<b>588,4</b>	<b>365,1</b>	<b>183,9</b>	<b>206,4</b>	<b>63,7</b>	<b>264,5</b>	<b>117,5</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 %	0,0 %	8,9 %	5,0 %
15-35	0,0 %	0,2 %	-0,2 %	0,0 %
36-60	0,0 %	0,1 %	0,1 %	0,1 %
61-90	-	2,5 %	-0,2 %	0,6 %
91-180	0,2 %	0,6 %	0,2 %	0,3 %
>180	-	1,2 %	2,4 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>1,9 %</b>	<b>1,2 %</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
Sector Financiero**	24	162	2223	1730	17	236	1262	1416	16	368	2022	1400
Intragrupa y off-shore***	0	1	1083	1039	0	0	899	353	19	0	814	854
Otros	162	22	299	837	236	17	271	663	349	16	197	778
<b>Total</b>	<b>186</b>	<b>186</b>	<b>3606</b>	<b>3606</b>	<b>253</b>	<b>253</b>	<b>2432</b>	<b>2432</b>	<b>384</b>	<b>384</b>	<b>3033</b>	<b>3033</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo