

**Fecha de Publicación: 29 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 27 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\$1042,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.<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	123,8	120,7	48,0	48,0	57,7	60,8	15,0
15-35	341,0	247,7	191,0	170,7	7,7	121,3	49,0
36-60	18,4	56,2	52,5	0,0	3,7	18,4	0,0
61-90	8,1	10,4	0,8	0,0	9,6	8,1	0,0
91-180	27,6	11,8	10,0	0,0	1,8	27,6	0,0
>180	47,6	29,1	25,0	20,0	4,1	27,6	0,0
<b>Total</b>	<b>566,5</b>	<b>475,8</b>	<b>327,3</b>	<b>238,7</b>	<b>84,6</b>	<b>263,8</b>	<b>64,0</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	11,5 %	2,7 %	-0,4 %	1,9 %
15-35	1,4 %	0,2 %	0,1 %	0,3 %
36-60	-	0,6 %	-0,1 %	0,0 %
61-90	-	0,6 %	0,0 %	0,3 %
91-180	-	0,6 %	0,2 %	0,3 %
>180	-	1,7 %	1,0 %	1,1 %
<b>Total</b>	<b>3,8 %</b>	<b>1,0 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,7 %</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	25 al 29 de Octubre				1 al 5 de Noviembre				8 al 12 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	31	351	2461	2006	12	176	1814	1690	12	140	1296	1304
Intragrupa y off-shore***	0	0	1092	1093	0	0	970	668	0	0	788	373
Otros	351	31	428	882	176	12	253	678	140	12	269	676
<b>Total</b>	<b>382</b>	<b>382</b>	<b>3981</b>	<b>3981</b>	<b>188</b>	<b>188</b>	<b>3036</b>	<b>3036</b>	<b>152</b>	<b>152</b>	<b>2353</b>	<b>2353</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