

**Fecha de Publicación: 6 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 04 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\$676,2 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         | 92,2                | 20,8         | 15,0                      | 21,0        | 5,8           | 71,2         | 0,0            |
| 15-35        | 134,4               | 288,2        | 215,5                     | 26,3        | 25,7          | 61,1         | 47,0           |
| 36-60        | 19,5                | 22,3         | 0,0                       | 0,0         | 22,3          | 19,5         | 0,0            |
| 61-90        | 37,2                | 0,1          | 0,0                       | 0,0         | 0,1           | 37,2         | 0,0            |
| 91-180       | 41,7                | 13,3         | 5,0                       | 20,0        | 8,3           | 21,7         | 0,0            |
| >180         | 4,4                 | 2,2          | 0,0                       | 0,0         | 2,2           | 4,4          | 0,0            |
| <b>Total</b> | <b>329,4</b>        | <b>346,9</b> | <b>235,5</b>              | <b>67,3</b> | <b>64,4</b>   | <b>215,1</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         | -                  | 0,0 %                        | -0,2 %        | -0,2 %       |
| 15-35        | 4,3 %              | 0,0 %                        | -0,3 %        | 0,6 %        |
| 36-60        | -                  | 0,2 %                        | -0,1 %        | 0,1 %        |
| 61-90        | -                  | 1,4 %                        | 0,0 %         | 0,1 %        |
| 91-180       | -                  | 0,7 %                        | 0,2 %         | 0,3 %        |
| >180         | -                  | 2,0 %                        | 1,3 %         | 1,5 %        |
| <b>Total</b> | <b>4,3 %</b>       | <b>0,1 %</b>                 | <b>-0,1 %</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**       | 21                | 199        | 2072        | 1794        | 17                  | 164        | 1808        | 1493        | 10                  | 234        | 1126        | 1180        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                 | 0          | 1044        | 693         | 0                   | 0          | 973         | 764         | 0                   | 0          | 834         | 332         |
| Otros                     | 199               | 21         | 305         | 934         | 164                 | 17         | 193         | 717         | 234                 | 10         | 150         | 598         |
| <b>Total</b>              | <b>220</b>        | <b>220</b> | <b>3421</b> | <b>3421</b> | <b>181</b>          | <b>181</b> | <b>2974</b> | <b>2974</b> | <b>245</b>          | <b>245</b> | <b>2111</b> | <b>2111</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