

**Fecha de Publicación: 19 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 14 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\$868,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,5%.<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	193,8	42,2	3,0	83,0	8,2	79,8	31,0
15-35	169,3	249,4	142,0	96,0	70,4	36,3	37,0
36-60	9,3	23,4	0,0	0,0	23,4	9,3	0,0
61-90	19,3	6,9	0,0	0,0	6,9	19,3	0,0
91-180	14,4	32,0	25,0	0,0	7,0	14,4	0,0
>180	70,7	37,5	5,0	63,0	32,2	7,4	0,3
<b>Total</b>	<b>476,6</b>	<b>391,3</b>	<b>175,0</b>	<b>242,0</b>	<b>148,0</b>	<b>166,4</b>	<b>68,3</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	-0,1 %	0,0 %	-1,6 %	-1,1 %
15-35	-0,4 %	-0,5 %	-1,1 %	-0,7 %
36-60	-	0,1 %	-1,2 %	-0,3 %
61-90	-	0,8 %	-0,8 %	-0,4 %
91-180	-	0,1 %	-0,1 %	0,1 %
>180	0,2 %	0,8 %	0,8 %	0,8 %
<b>Total</b>	<b>-0,3 %</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>-0,8 %</b>	<b>-0,5 %</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**	25	167	2325	1757	17	237	1408	1447	17	368	2082	1547
Intragrupa y off-shore***	0	1	1095	1119	0	0	902	391	19	0	825	860
Otros	167	24	295	839	236	17	279	750	350	17	312	812
<b>Total</b>	<b>192</b>	<b>192</b>	<b>3715</b>	<b>3715</b>	<b>254</b>	<b>254</b>	<b>2588</b>	<b>2588</b>	<b>385</b>	<b>385</b>	<b>3219</b>	<b>3219</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