

**Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 15 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\$883,3 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	79,8	50,7	32,8	17,0	13,0	57,8	5,0
15-35	145,0	211,9	91,3	60,0	43,7	8,0	77,0
36-60	155,4	64,2	0,0	130,0	44,2	5,4	20,0
61-90	20,2	22,1	20,0	0,0	2,1	20,2	0,0
91-180	53,3	46,5	3,0	0,0	7,5	17,3	36,0
>180	22,8	11,4	0,0	5,0	1,4	7,8	10,0
<b>Total</b>	<b>476,4</b>	<b>406,9</b>	<b>147,0</b>	<b>212,0</b>	<b>111,9</b>	<b>116,4</b>	<b>148,0</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	-1,0 %	-1,8 %	-2,2 %	-2,1 %
15-35	-0,4 %	-1,1 %	0,3 %	-0,5 %
36-60	-1,1 %	-0,3 %	-1,7 %	-0,6 %
61-90	-	-0,4 %	-1,2 %	-0,7 %
91-180	-0,2 %	0,5 %	0,0 %	0,0 %
>180	14,2 %	1,5 %	0,2 %	6,1 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>-0,8 %</b>	<b>-0,9 %</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	166	2325	1763	18	220	1495	1481	18	369	2074	1580
Intragrupa y off-shore***	0	1	1095	1119	0	0	912	391	19	0	847	877
Otros	166	24	300	839	220	18	297	831	350	18	322	786
<b>Total</b>	<b>191</b>	<b>191</b>	<b>3720</b>	<b>3720</b>	<b>239</b>	<b>239</b>	<b>2704</b>	<b>2704</b>	<b>386</b>	<b>386</b>	<b>3243</b>	<b>3243</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