

**Fecha de Publicación: 27 de Octubre de 2010**  
**Fecha de Información: 25 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\$1060,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.<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	161,4	150,3	85,0	80,0	9,3	25,4	56,0
15-35	260,3	258,2	152,5	150,0	26,7	31,3	79,0
36-60	7,3	91,6	76,0	0,3	15,6	7,0	0,0
61-90	20,3	2,1	0,0	0,0	2,1	20,3	0,0
91-180	52,9	8,1	0,0	0,0	8,1	52,9	0,0
>180	15,4	32,5	30,0	0,0	2,5	15,4	0,0
<b>Total</b>	<b>517,5</b>	<b>542,9</b>	<b>343,5</b>	<b>230,3</b>	<b>64,4</b>	<b>152,2</b>	<b>135,0</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 %	0,8 %	0,4 %
15-35	4,5 %	1,0 %	0,1 %	1,2 %
36-60	-	0,3 %	-0,2 %	0,3 %
61-90	-	1,0 %	-0,1 %	0,0 %
91-180	-	0,9 %	0,3 %	0,4 %
>180	-	0,8 %	0,7 %	0,8 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,8 %</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	355	2365	1837	10	175	1691	1650	10	139	1238	1166
Intragrupa y off-shore***	4	0	945	1020	0	0	967	619	0	0	708	373
Otros	351	31	425	878	175	10	231	619	139	10	226	633
<b>Total</b>	<b>386</b>	<b>386</b>	<b>3735</b>	<b>3735</b>	<b>184</b>	<b>184</b>	<b>2889</b>	<b>2889</b>	<b>149</b>	<b>149</b>	<b>2172</b>	<b>2172</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