

**Fecha de Publicación: 15 de Julio de 2010**  
**Fecha de Información: 13 de Julio 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\$953,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 00%.<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	177,9	127,2	54,5	78,1	57,7	84,8	15,0
15-35	155,5	271,8	179,1	83,6	53,1	32,3	39,6
36-60	46,3	43,7	20,0	0,0	18,6	41,3	5,0
61-90	33,3	7,7	0,0	0,0	7,5	33,1	0,2
91-180	61,8	8,8	0,0	0,0	8,7	61,8	0,0
>180	5,9	13,1	5,0	0,0	8,1	5,9	0,0
<b>Total</b>	<b>480,8</b>	<b>472,2</b>	<b>258,6</b>	<b>161,7</b>	<b>153,7</b>	<b>259,2</b>	<b>59,9</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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 %	-0,1 %	0,1 %	0,0 %
15-35	-0,3 %	-0,2 %	-0,4 %	-0,3 %
36-60	0,1 %	0,4 %	0,0 %	0,2 %
61-90	0,6 %	2,0 %	0,0 %	0,4 %
91-180	1,7 %	1,0 %	0,4 %	0,5 %
>180	-	1,7 %	1,5 %	1,6 %
<b>Total</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,0 %</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	12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	219	1795	1641	9	115	1136	1220	6	198	1244	962
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	956	500	0	0	723	299	0	0	612	478
<b>Otros</b>	219	15	415	1025	115	9	247	587	198	6	193	609
<b>Total</b>	<b>234</b>	<b>234</b>	<b>3166</b>	<b>3166</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>2105</b>	<b>2105</b>	<b>204</b>	<b>204</b>	<b>2050</b>	<b>2050</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo