

**Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2010**  
**Fecha de Información: 23 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\$725,7 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	136,3	112,1	50,0	65,0	32,1	41,3	30,0
15-35	72,1	179,9	86,0	22,0	78,9	35,1	15,0
36-60	29,2	105,1	55,5	0,0	24,5	4,2	25,0
61-90	28,9	9,5	0,0	0,0	9,5	28,9	0,0
91-180	39,1	13,5	10,0	0,0	3,5	39,1	0,0
>180	0,2	0,0	0,0	0,0	0,0	0,2	0,0
<b>Total</b>	<b>305,8</b>	<b>420,0</b>	<b>201,5</b>	<b>87,0</b>	<b>148,5</b>	<b>148,8</b>	<b>70,0</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	5,4 %	-0,5 %	-1,0 %	0,3 %
15-35	0,3 %	0,1 %	-0,9 %	-0,1 %
36-60	-0,1 %	0,2 %	-0,3 %	0,0 %
61-90	-	1,0 %	0,0 %	0,2 %
91-180	-	0,6 %	0,0 %	0,1 %
>180	-	-	1,8 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>2,4 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>-0,6 %</b>	<b>0,1 %</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	19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	113	1541	1508	7	194	1637	1355	7	257	1179	1124
Intragrupa y off-shore***	0	1	825	494	0	0	778	554	0	0	666	398
Otros	113	9	387	751	194	7	340	846	257	7	239	562
<b>Total</b>	<b>123</b>	<b>123</b>	<b>2753</b>	<b>2753</b>	<b>201</b>	<b>201</b>	<b>2754</b>	<b>2754</b>	<b>263</b>	<b>263</b>	<b>2084</b>	<b>2084</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