

**Fecha de Publicación: 6 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 04 de Agosto 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\$1078,5 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	149,6	96,8	26,0	43,0	42,8	78,6	28,0
15-35	288,9	321,3	149,0	89,4	76,3	103,6	96,0
36-60	46,0	33,9	0,0	0,0	23,9	36,0	10,0
61-90	38,4	15,6	0,0	0,0	15,6	38,4	0,0
91-180	17,6	25,9	18,0	0,0	7,9	17,6	0,0
>180	0,2	44,3	30,0	0,0	14,3	0,2	0,0
<b>Total</b>	<b>540,8</b>	<b>537,8</b>	<b>223,0</b>	<b>132,4</b>	<b>180,8</b>	<b>274,4</b>	<b>134,0</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	-11,6 %	-0,5 %	-0,6 %	-2,2 %
15-35	0,7 %	0,1 %	-0,2 %	0,1 %
36-60	-0,3 %	0,3 %	-0,1 %	0,0 %
61-90	-	0,8 %	0,2 %	0,4 %
91-180	-	0,9 %	0,4 %	0,7 %
>180	-	2,1 %	0,6 %	2,1 %
<b>Total</b>	<b>-1,9 %</b>	<b>0,3 %</b>	<b>-0,2 %</b>	<b>-0,3 %</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	2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	256	1549	1356	10	260	1798	1695	16	61	1091	1396
Intragrupa y off-shore***	0	0	764	555	0	0	850	452	0	0	1057	475
Otros	256	9	342	744	260	10	396	897	61	16	213	489
<b>Total</b>	<b>266</b>	<b>266</b>	<b>2655</b>	<b>2655</b>	<b>270</b>	<b>270</b>	<b>3044</b>	<b>3044</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>2361</b>	<b>2361</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