

**Fecha de Publicación: 9 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 05 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\$898,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.<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	174,7	62,0	26,5	93,0	15,5	61,7	20,0
15-35	203,2	298,7	146,0	48,5	114,7	116,7	38,0
36-60	13,0	10,2	4,0	0,0	6,2	13,0	0,0
61-90	34,1	34,6	0,0	0,0	11,1	10,6	23,5
91-180	27,1	18,8	2,4	0,3	16,4	26,9	0,0
>180	12,8	9,3	0,0	0,0	9,3	12,8	0,0
<b>Total</b>	<b>464,9</b>	<b>433,6</b>	<b>178,9</b>	<b>141,8</b>	<b>173,2</b>	<b>241,6</b>	<b>81,5</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	5,0 %	2,8 %	1,5 %	2,0 %
15-35	-0,3 %	1,1 %	-0,9 %	0,3 %
36-60	-	0,5 %	-0,2 %	0,1 %
61-90	0,1 %	1,3 %	0,1 %	0,4 %
91-180	-	1,3 %	0,5 %	0,8 %
>180	-	1,8 %	2,1 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,2 %</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	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	235	1577	1368	10	260	1923	1717	17	61	1112	1425
Intragrupa y off-shore***	0	0	775	568	0	0	866	532	0	0	1057	475
Otros	235	9	343	759	260	10	402	942	61	17	221	490
<b>Total</b>	<b>244</b>	<b>244</b>	<b>2695</b>	<b>2695</b>	<b>270</b>	<b>270</b>	<b>3191</b>	<b>3191</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>2390</b>	<b>2390</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