

**Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 06 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\$916,1 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	132,6	67,4	19,5	33,5	42,9	94,1	5,0
15-35	273,4	345,3	99,5	89,5	183,5	121,6	62,3
36-60	26,0	24,7	0,0	10,0	14,7	6,0	10,0
61-90	2,1	11,6	0,0	0,0	11,6	2,1	0,0
91-180	2,0	15,7	0,0	0,0	15,7	2,0	0,0
>180	5,1	10,2	0,0	0,0	10,2	5,1	0,0
<b>Total</b>	<b>441,2</b>	<b>474,9</b>	<b>119,0</b>	<b>133,0</b>	<b>278,7</b>	<b>230,9</b>	<b>77,3</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 %	2,3 %	1,5 %
15-35	1,7 %	0,6 %	-1,1 %	0,1 %
36-60	-0,2 %	0,4 %	0,0 %	0,1 %
61-90	-	0,8 %	-0,1 %	0,7 %
91-180	-	1,2 %	0,6 %	1,1 %
>180	-	1,5 %	2,3 %	1,8 %
<b>Total</b>	<b>1,3 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>0,1 %</b>	<b>0,5 %</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	1578	1373	11	260	1994	1766	17	61	1173	1442
Intragrupa y off-shore***	0	0	775	568	0	0	885	554	0	0	1057	487
Otros	235	9	348	760	260	11	427	986	61	17	238	539
<b>Total</b>	<b>245</b>	<b>245</b>	<b>2700</b>	<b>2700</b>	<b>271</b>	<b>271</b>	<b>3306</b>	<b>3306</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>2468</b>	<b>2468</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