

**Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 09 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\$1024,1 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	84,3	87,8	38,6	45,3	49,2	39,0	0,0
15-35	271,4	331,7	160,5	61,5	113,2	151,9	58,0
36-60	108,7	2,9	0,0	0,0	2,9	108,7	0,0
61-90	25,3	2,6	0,0	0,0	2,6	25,3	0,0
91-180	29,8	32,9	15,0	0,0	8,5	20,4	9,5
>180	8,7	38,1	10,0	0,0	28,1	8,7	0,0
<b>Total</b>	<b>528,1</b>	<b>496,0</b>	<b>224,1</b>	<b>106,8</b>	<b>204,4</b>	<b>353,9</b>	<b>67,5</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	-	0,0 %	0,3 %	0,2 %
15-35	2,6 %	0,2 %	-0,7 %	0,1 %
36-60	-	1,0 %	-0,5 %	-0,5 %
61-90	-	1,1 %	0,2 %	0,3 %
91-180	0,4 %	0,9 %	0,3 %	0,6 %
>180	-	1,9 %	2,3 %	2,0 %
<b>Total</b>	<b>2,2 %</b>	<b>0,4 %</b>	<b>-0,3 %</b>	<b>0,2 %</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	9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	260	2058	1805	17	69	1193	1483	6	221	1501	1024
Intragrupa y off-shore***	0	0	923	594	0	0	1058	493	0	0	571	489
Otros	260	11	428	1011	69	17	279	554	221	6	211	770
<b>Total</b>	<b>271</b>	<b>271</b>	<b>3409</b>	<b>3409</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>2530</b>	<b>2530</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>2283</b>	<b>2283</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