

**Fecha de Publicación: 19 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 17 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\$1190,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	99,0	176,7	78,7	55,2	78,0	23,8	20,0
15-35	295,9	437,4	314,7	121,0	86,7	138,9	36,0
36-60	54,5	13,6	0,0	0,0	13,6	54,5	0,0
61-90	18,0	11,9	2,1	0,0	9,7	18,0	0,0
91-180	3,2	11,5	0,1	0,0	11,4	3,2	0,0
>180	23,0	45,3	10,0	0,0	32,3	20,0	3,0
<b>Total</b>	<b>493,7</b>	<b>696,4</b>	<b>405,6</b>	<b>176,2</b>	<b>231,8</b>	<b>258,5</b>	<b>59,0</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	6,3 %	1,7 %	0,5 %	1,9 %
15-35	6,0 %	1,1 %	-0,6 %	0,7 %
36-60	-	2,3 %	1,4 %	1,6 %
61-90	-	1,9 %	1,1 %	1,4 %
91-180	-	1,9 %	-4,7 %	0,5 %
>180	1,7 %	1,8 %	2,1 %	1,9 %
<b>Total</b>	<b>5,9 %</b>	<b>1,4 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>1,1 %</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	16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	72	1417	1664	9	223	1684	1265	3	415	1441	1449
Intragrupa y off-shore***	8	1	1169	583	0	0	669	533	0	0	849	555
Otros	64	14	329	668	223	9	318	873	415	3	320	606
<b>Total</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>2915</b>	<b>2915</b>	<b>232</b>	<b>232</b>	<b>2671</b>	<b>2671</b>	<b>417</b>	<b>417</b>	<b>2610</b>	<b>2610</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo