

**Fecha de Publicación: 23 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 19 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\$631,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.<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	76,9	70,8	37,7	60,8	33,1	16,2	0,0
15-35	112,5	248,1	170,0	73,0	47,1	8,5	31,0
36-60	31,9	3,6	0,0	0,0	3,6	31,9	0,0
61-90	7,6	35,2	30,0	0,0	5,2	7,6	0,0
91-180	3,2	15,4	5,0	0,0	10,4	3,2	0,0
>180	23,4	3,1	0,0	23,0	3,1	0,4	0,0
<b>Total</b>	<b>255,6</b>	<b>376,3</b>	<b>242,7</b>	<b>156,8</b>	<b>102,6</b>	<b>67,8</b>	<b>31,0</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	-	1,5 %	0,4 %	0,9 %
15-35	0,9 %	1,1 %	0,8 %	1,0 %
36-60	-	1,5 %	0,7 %	0,8 %
61-90	-	1,1 %	1,0 %	1,0 %
91-180	-	1,6 %	0,2 %	1,4 %
>180	-	2,4 %	2,3 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>1,0 %</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**	13	73	1438	1667	12	225	1859	1475	3	415	1516	1528
Intragrupa y off-shore***	8	1	1189	629	0	0	755	566	0	0	895	576
Otros	65	12	312	643	225	12	362	934	415	3	353	660
<b>Total</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>2939</b>	<b>2939</b>	<b>236</b>	<b>236</b>	<b>2975</b>	<b>2975</b>	<b>418</b>	<b>418</b>	<b>2764</b>	<b>2764</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