

**Fecha de Publicación: 31 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 27 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\$786,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.<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	98,9	38,6	3,0	48,0	35,6	50,9	0,0
15-35	286,4	220,5	123,5	76,5	53,0	165,9	44,0
36-60	32,4	46,7	0,0	0,0	46,7	32,4	0,0
61-90	49,3	4,1	0,0	0,0	4,1	49,3	0,0
91-180	0,9	4,6	0,0	0,0	4,6	0,9	0,0
>180	0,9	2,8	0,0	0,0	2,8	0,9	0,0
<b>Total</b>	<b>468,8</b>	<b>317,3</b>	<b>126,5</b>	<b>124,5</b>	<b>146,8</b>	<b>300,3</b>	<b>44,0</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	-	1,3 %	0,1 %	0,5 %
15-35	0,2 %	0,5 %	0,1 %	0,3 %
36-60	-	0,9 %	0,3 %	0,7 %
61-90	-	1,0 %	0,5 %	0,6 %
91-180	-	1,4 %	0,4 %	1,2 %
>180	-	1,2 %	1,9 %	1,4 %
<b>Total</b>	<b>0,2 %</b>	<b>0,7 %</b>	<b>0,2 %</b>	<b>0,4 %</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	23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	9	233	2062	1614	5	431	1892	1945	4	495	1638	1431
Intragrupa y off-shore***	0	0	860	664	0	0	1045	692	0	0	726	513
Otros	233	9	364	1007	431	5	500	800	494	4	351	772
<b>Total</b>	<b>242</b>	<b>242</b>	<b>3285</b>	<b>3285</b>	<b>437</b>	<b>437</b>	<b>3437</b>	<b>3437</b>	<b>498</b>	<b>498</b>	<b>2715</b>	<b>2715</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