

Fecha de Publicación: 2 de Septiembre de 2010

Fecha de Información: 31 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\$732,8 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	115,9	62,1	20,0	81,0	42,1	34,9	0,0
15-35	88,1	277,3	185,8	11,0	61,0	46,6	30,5
36-60	66,9	34,0	8,0	4,5	23,0	59,4	3,0
61-90	20,6	1,3	0,0	0,0	1,3	20,6	0,0
91-180	6,9	33,4	13,0	0,0	17,4	3,9	3,0
>180	14,3	12,0	0,0	0,0	6,0	8,3	6,0
<b>Total</b>	<b>312,7</b>	<b>420,1</b>	<b>226,8</b>	<b>96,5</b>	<b>150,8</b>	<b>173,7</b>	<b>42,5</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	-	0,5 %	-0,1 %	0,2 %
15-35	0,3 %	0,5 %	-0,1 %	0,3 %
36-60	0,0 %	0,9 %	0,1 %	0,3 %
61-90	-	1,4 %	0,3 %	0,4 %
91-180	0,0 %	0,8 %	0,2 %	0,6 %
>180	2,1 %	1,8 %	1,3 %	1,7 %
<b>Total</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>0,0 %</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	30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	435	2005	1997	5	495	1742	1465	10	167	1421	1483
Intragrupa y off-shore***	0	0	1087	752	0	0	726	591	0	0	878	499
Otros	435	7	503	846	494	5	384	797	167	10	334	652
<b>Total</b>	<b>442</b>	<b>442</b>	<b>3595</b>	<b>3595</b>	<b>499</b>	<b>499</b>	<b>2853</b>	<b>2853</b>	<b>176</b>	<b>176</b>	<b>2634</b>	<b>2634</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