

**Fecha de Publicación: 8 de Septiembre de 2010**  
**Fecha de Información: 06 de Septiembre 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\$386,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.<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	73,3	82,8	24,0	0,0	3,3	17,8	55,5
15-35	107,7	99,0	6,0	31,0	37,5	21,2	55,5
36-60	3,9	11,4	0,0	0,0	11,4	3,9	0,0
61-90	0,2	1,9	0,0	0,0	1,9	0,2	0,0
91-180	0,0	5,5	0,0	0,0	5,5	0,0	0,0
>180	0,0	1,2	0,0	0,0	1,2	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>185,1</b>	<b>201,8</b>	<b>30,0</b>	<b>31,0</b>	<b>60,8</b>	<b>43,1</b>	<b>111,0</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	0,0 %	0,1 %	-9,7 %	-1,7 %
15-35	7,5 %	1,2 %	0,2 %	3,2 %
36-60	-	1,0 %	0,3 %	0,9 %
61-90	-	1,0 %	0,6 %	1,0 %
91-180	-	1,7 %	-	1,7 %
>180	-	3,2 %	-	3,2 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>0,9 %</b>	<b>-2,2 %</b>	<b>1,2 %</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	6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	510	1858	1600	16	167	1643	1722	7	141	1385	1291
Intragrupa y off-shore***	0	0	770	604	0	0	911	635	0	0	902	587
Otros	510	11	437	861	167	16	505	702	141	7	223	633
<b>Total</b>	<b>521</b>	<b>521</b>	<b>3064</b>	<b>3064</b>	<b>183</b>	<b>183</b>	<b>3058</b>	<b>3058</b>	<b>148</b>	<b>148</b>	<b>2510</b>	<b>2510</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo