

**Fecha de Publicación: 09 de Marzo de 2010**  
**Fecha de Información: 05 de Marzo 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\$980 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		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	151.5	112.4	45.0	13.0	67.3	138.5	263.9
15-35	119.7	452.7	222.7	35.5	186.0	40.1	528.3
36-60	50.1	18.1	8.0	0.0	10.1	50.1	68.2
61-90	72.0	10.2	0.0	0.0	10.2	72.0	82.2
91-180	10.8	13.0	0.0	5.0	7.7	0.6	18.5
>180	10.0	8.4	0.0	10.0	8.4	0.0	18.4
<b>Total</b>	<b>414.1</b>	<b>614.8</b>	<b>275.7</b>	<b>63.5</b>	<b>289.8</b>	<b>301.3</b>	<b>979.6</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con 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	0.7 %	3.9 %	0.9 %	2.0 %
15-35	0.6 %	0.8 %	0.3 %	0.7 %
36-60	-	1.2 %	0.3 %	0.5 %
61-90	-	1.6 %	1.7 %	1.7 %
91-180	2.7 %	3.1 %	2.9 %	2.9 %
>180	-	3.5 %	3.1 %	3.3 %
<b>Total</b>	<b>0.8 %</b>	<b>1.4 %</b>	<b>0.9 %</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**

Sectores	1 al 5 de Marzo				8 al 12 de Marzo				15 al 19 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	35	2122	1950	9	30	1975	1788	12	100	2231	2335
Intragrupa y off-shore***	0	0	910	719	0	0	966	597	0	0	1314	699
Otros	35	10	655	1018	30	9	363	919	100	12	582	1092
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>3687</b>	<b>3687</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>3304</b>	<b>3304</b>	<b>112</b>	<b>112</b>	<b>4126</b>	<b>4126</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*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