

**Fecha de Publicación: 22 de Julio de 2010**  
**Fecha de Información: 19 de Julio 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\$643,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

| Rango        | Sector Financiero** |              | Intragruppo y Off-shore*** |              | Otros Agentes |             | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|----------------------------|--------------|---------------|-------------|----------------|
|              | Compras             | Ventas       | Compras                    | Ventas       | Compras       | Ventas      |                |
| 3-14         | 46,1                | 59,8         | 16,0                       | 10,0         | 33,8          | 26,1        | 10,0           |
| 15-35        | 283,0               | 129,7        | 83,0                       | 234,0        | 9,7           | 12,0        | 37,0           |
| 36-60        | 0,1                 | 7,7          | 0,0                        | 0,0          | 7,7           | 0,1         | 0,0            |
| 61-90        | 27,0                | 1,2          | 0,0                        | 0,0          | 1,2           | 27,0        | 0,0            |
| 91-180       | 0,2                 | 34,6         | 30,0                       | 0,0          | 4,6           | 0,2         | 0,0            |
| >180         | 40,0                | 13,7         | 5,0                        | 0,0          | 0,7           | 32,0        | 8,0            |
| <b>Total</b> | <b>396,5</b>        | <b>246,7</b> | <b>134,0</b>               | <b>244,0</b> | <b>57,7</b>   | <b>97,5</b> | <b>55,0</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 intragruppo |              | Total        |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas     | Compras                       | Ventas       |              |
| 3-14         | 11,4 %             | 0,7 %                         | 0,1 %        | 1,7 %        |
| 15-35        | 0,5 %              | 0,8 %                         | 0,7 %        | 0,7 %        |
| 36-60        | -                  | 1,7 %                         | 0,7 %        | 1,7 %        |
| 61-90        | -                  | 1,7 %                         | 1,0 %        | 1,0 %        |
| 91-180       | -                  | 1,3 %                         | 0,9 %        | 1,3 %        |
| >180         | 1,7 %              | 2,0 %                         | 2,0 %        | 1,9 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,7 %</b>       | <b>1,0 %</b>                  | <b>0,8 %</b> | <b>1,1 %</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                            | 19 al 23 de Julio |            |             |             | 26 al 30 de Julio |            |             |             | 2 al 6 de Agosto |            |             |             |
|-----------------------------------|-------------------|------------|-------------|-------------|-------------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
|                                   | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery          |            | NDF         |             | Delivery         |            | NDF         |             |
|                                   | C                 | V          | C           | V           | C                 | V          | C           | V           | C                | V          | C           | V           |
| <b>Sector Financiero**</b>        | 11                | 113        | 1484        | 1450        | 7                 | 194        | 1420        | 1168        | 5                | 256        | 1054        | 1057        |
| <b>Intragruppo y off-shore***</b> | 0                 | 1          | 766         | 438         | 0                 | 0          | 740         | 478         | 0                | 0          | 611         | 398         |
| <b>Otros</b>                      | 113               | 10         | 388         | 751         | 194               | 7          | 261         | 775         | 256              | 5          | 227         | 437         |
| <b>Total</b>                      | <b>124</b>        | <b>124</b> | <b>2639</b> | <b>2639</b> | <b>201</b>        | <b>201</b> | <b>2421</b> | <b>2421</b> | <b>261</b>       | <b>261</b> | <b>1892</b> | <b>1892</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 intragruppo