

**Fecha de Publicación: 30 de Agosto de 2010**  
**Fecha de Información: 26 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\$1102,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.<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         | 179,5               | 127,5        | 59,0                      | 108,9        | 49,5          | 51,6         | 19,0           |
| 15-35        | 366,3               | 244,0        | 91,5                      | 176,5        | 59,5          | 96,9         | 93,0           |
| 36-60        | 41,7                | 19,1         | 0,0                       | 0,0          | 19,1          | 41,7         | 0,0            |
| 61-90        | 1,5                 | 20,5         | 3,0                       | 0,0          | 17,5          | 1,5          | 0,0            |
| 91-180       | 34,1                | 27,7         | 5,0                       | 0,0          | 7,7           | 19,1         | 15,0           |
| >180         | 5,3                 | 35,7         | 32,7                      | 3,0          | 3,0           | 2,3          | 0,0            |
| <b>Total</b> | <b>628,4</b>        | <b>474,4</b> | <b>191,2</b>              | <b>288,4</b> | <b>156,2</b>  | <b>213,0</b> | <b>127,0</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         | 0,2 %              | 1,6 %                        | 0,3 %        | 0,9 %        |
| 15-35        | 2,6 %              | 1,8 %                        | 0,2 %        | 1,1 %        |
| 36-60        | -                  | 0,9 %                        | 0,2 %        | 0,4 %        |
| 61-90        | -                  | 0,9 %                        | -0,1 %       | 0,8 %        |
| 91-180       | 0,8 %              | 1,3 %                        | 0,4 %        | 0,8 %        |
| >180         | -                  | 2,5 %                        | 2,2 %        | 2,3 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,0 %</b>       | <b>1,6 %</b>                 | <b>0,2 %</b> | <b>1,0 %</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                  | 230        | 2061        | 1616        | 5                             | 416        | 1857        | 1933        | 4                     | 495        | 1575        | 1419        |
| Intragrupa y off-shore*** | 0                  | 0          | 860         | 664         | 0                             | 0          | 1042        | 670         | 0                     | 0          | 726         | 487         |
| Otros                     | 230                | 9          | 366         | 1006        | 416                           | 5          | 492         | 787         | 495                   | 4          | 339         | 734         |
| <b>Total</b>              | <b>238</b>         | <b>238</b> | <b>3287</b> | <b>3287</b> | <b>421</b>                    | <b>421</b> | <b>3390</b> | <b>3390</b> | <b>498</b>            | <b>498</b> | <b>2640</b> | <b>2640</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