

**Fecha de Publicación: 24 de Junio de 2010**  
**Fecha de Información: 22 de Junio 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\$730 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.4%.<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	119.9	56.3	9.0	61.6	17.3	28.3	30.0
15-35	223.1	219.5	158.5	97.0	20.0	85.1	41.0
36-60	14.2	4.0	0.0	0.0	4.0	14.2	0.0
61-90	17.5	7.4	0.0	0.0	7.4	17.5	0.0
91-180	6.8	49.2	20.0	0.0	29.1	6.7	0.1
>180	0.0	12.4	10.0	0.0	2.4	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>381.5</b>	<b>348.8</b>	<b>197.5</b>	<b>158.6</b>	<b>80.2</b>	<b>151.8</b>	<b>71.1</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 %	0.7 %	3.2 %	2.2 %
15-35	0.6 %	2.2 %	0.3 %	1.2 %
36-60	-	1.4 %	0.6 %	0.8 %
61-90	-	1.7 %	0.9 %	1.1 %
91-180	2.2 %	1.7 %	1.2 %	1.6 %
>180	-	2.0 %	-	2.0 %
<b>Total</b>	<b>0.4 %</b>	<b>1.9 %</b>	<b>1.2 %</b>	<b>1.4 %</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	21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	58	1500	1580	9	232	1613	1661	8	191	825	1001
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	947	448	0	0	1128	674	0	0	718	321
<b>Otros</b>	58	20	395	814	232	9	251	657	191	8	201	421
<b>Total</b>	<b>78</b>	<b>78</b>	<b>2842</b>	<b>2842</b>	<b>241</b>	<b>241</b>	<b>2992</b>	<b>2992</b>	<b>199</b>	<b>199</b>	<b>1744</b>	<b>1744</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