

**Fecha de Publicación: 24 de Mayo de 2010**  
**Fecha de Información: 20 de Mayo 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\$1,231 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.5%.<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	104.6	240.3	129.0	14.9	111.3	89.7	0.0
15-35	342.2	298.8	199.0	141.0	58.8	160.2	41.0
36-60	34.1	18.5	13.0	0.0	5.5	34.1	0.0
61-90	25.5	11.7	5.0	0.0	0.3	19.1	6.4
91-180	55.6	67.4	65.0	0.0	2.2	55.3	0.3
>180	21.4	10.9	0.0	0.0	10.9	21.4	0.0
<b>Total</b>	<b>583.4</b>	<b>647.7</b>	<b>411.0</b>	<b>155.9</b>	<b>189.0</b>	<b>379.9</b>	<b>47.7</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	-	2.8 %	1.0 %	2.1 %
15-35	1.8 %	1.5 %	0.5 %	1.0 %
36-60	-	2.2 %	1.4 %	1.5 %
61-90	1.7 %	2.1 %	1.6 %	1.7 %
91-180	1.8 %	2.2 %	1.8 %	1.9 %
>180	-	2.0 %	2.0 %	2.0 %
<b>Total</b>	<b>1.8 %</b>	<b>2.0 %</b>	<b>0.9 %</b>	<b>1.5 %</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	17 al 21 de Mayo				24 al 28 de Mayo				31 de May. al 4 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	14	80	1707	1902	16	88	2163	2257	6	83	1280	1690
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	1	1018	600	0	0	1210	482	11	0	1213	396
<b>Otros</b>	80	13	616	839	88	16	561	1195	72	6	247	654
<b>Total</b>	<b>94</b>	<b>94</b>	<b>3341</b>	<b>3341</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>3934</b>	<b>3934</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>2740</b>	<b>2740</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