

**Fecha de Publicación: 21 de Junio de 2010**  
**Fecha de Información: 17 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\$820 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.2%.<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	51.9	127.3	88.9	0.0	38.4	51.9	0.0
15-35	201.2	258.6	175.0	27.5	73.1	163.2	10.5
36-60	52.7	3.0	0.0	0.0	3.0	52.7	0.0
61-90	34.3	18.3	2.0	0.0	16.3	34.3	0.0
91-180	14.9	11.9	0.0	0.0	11.9	14.9	0.0
>180	16.4	29.5	0.0	0.0	29.5	16.4	0.0
<b>Total</b>	<b>371.3</b>	<b>448.5</b>	<b>265.9</b>	<b>27.5</b>	<b>172.1</b>	<b>333.3</b>	<b>10.5</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	-	0.4 %	-0.1 %	0.1 %
15-35	-0.5 %	0.5 %	-1.0 %	-0.2 %
36-60	-	2.1 %	0.2 %	0.4 %
61-90	-	1.5 %	0.6 %	0.9 %
91-180	-	1.9 %	0.8 %	1.3 %
>180	-	2.5 %	2.0 %	2.3 %
<b>Total</b>	<b>-0.5 %</b>	<b>0.8 %</b>	<b>-0.3 %</b>	<b>0.2 %</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**

Sector	14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	41	1893	1505	17	57	1393	1529	9	231	1417	1545
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	1	915	688	0	0	944	352	0	0	1100	613
<b>Otros</b>	38	11	353	968	57	17	365	820	230	9	224	583
<b>Total</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>3161</b>	<b>3161</b>	<b>74</b>	<b>74</b>	<b>2701</b>	<b>2701</b>	<b>239</b>	<b>239</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 intragruppo