

**Fecha de Publicación: 23 de Junio de 2010**  
**Fecha de Información: 21 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\$637 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.<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	147.4	56.8	14.0	92.8	21.7	33.5	21.1
15-35	138.9	174.5	81.3	28.0	34.2	51.9	59.0
36-60	51.0	32.8	20.0	0.0	6.7	44.9	6.1
61-90	0.2	3.2	0.0	0.0	3.2	0.2	0.0
91-180	19.4	12.1	0.0	0.0	12.1	19.4	0.0
>180	0.0	0.6	0.0	0.0	0.6	0.0	0.0
<b>Total</b>	<b>356.9</b>	<b>279.9</b>	<b>115.3</b>	<b>120.8</b>	<b>78.4</b>	<b>149.9</b>	<b>86.2</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	3.9 %	0.6 %	0.8 %	1.2 %
15-35	0.6 %	1.3 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.1 %	1.4 %	0.8 %	1.0 %
61-90	-	1.9 %	0.6 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.4 %	1.6 %
>180	-	2.6 %	-	2.6 %
<b>Total</b>	<b>1.5 %</b>	<b>1.3 %</b>	<b>0.9 %</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	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>	18	58	1493	1576	9	230	1540	1611	7	189	794	1000
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	947	410	0	0	1119	650	0	0	718	306
<b>Otros</b>	58	18	390	845	230	9	240	638	189	7	199	405
<b>Total</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>2830</b>	<b>2830</b>	<b>240</b>	<b>240</b>	<b>2899</b>	<b>2899</b>	<b>196</b>	<b>196</b>	<b>1711</b>	<b>1711</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