

**Fecha de Publicación: 2 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 30 de Junio de 2009 <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\$662,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	313,2	54,0	6,8	225,0	31,6	72,5	351,5
15-35	150,4	109,8	60,0	48,6	12,8	64,8	223,2
36-60	17,7	9,0	0,0	0,0	9,0	17,7	26,8
61-90	0,4	18,4	17,0	0,0	1,4	0,4	18,8
91-180	0,6	27,5	0,0	0,0	27,5	0,6	28,2
>180	10,0	4,2	0,0	0,0	4,2	10,0	14,2
<b>Total</b>	<b>492,4</b>	<b>222,8</b>	<b>83,8</b>	<b>273,6</b>	<b>86,4</b>	<b>166,2</b>	<b>662,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con 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	20,3 %	7,6 %	5,2 %	7,6 %
15-35	5,7 %	6,5 %	5,8 %	6,0 %
36-60	-	6,4 %	5,4 %	5,7 %
61-90	-	5,6 %	4,4 %	5,6 %
91-180	-	5,9 %	4,3 %	5,8 %
>180	-	5,3 %	4,6 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>10,1 %</b>	<b>6,4 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>6,4 %</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**

Sectores	29 de Jun. al 3 de Julio				6 al 10 de Julio				13 al 17 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	22	1747	1538	10	23	1457	1361	8	35	1163	1085
Intragrupa y off-shore***	0	0	933	663	0	0	909	477	0	0	624	299
Otros	22	13	332	812	23	10	190	719	35	8	324	727
<b>Total</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>3012</b>	<b>3012</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>2557</b>	<b>2557</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>2111</b>	<b>2111</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*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