

**Fecha de Publicación: 25 de Junio de 2009**  
**Fecha de Información: 23 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\$1007,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.<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	333,1	114,3	4,0	225,0	48,4	46,2	385,5
15-35	365,8	230,1	119,3	135,0	86,2	206,1	571,2
36-60	14,5	9,9	0,0	0,0	9,9	14,5	24,5
61-90	0,4	4,3	2,8	0,0	1,5	0,4	4,7
91-180	7,5	2,5	0,0	1,0	2,5	6,5	10,0
>180	2,7	8,7	0,0	0,0	8,7	2,7	11,4
<b>Total</b>	<b>723,9</b>	<b>369,9</b>	<b>126,1</b>	<b>361,0</b>	<b>157,3</b>	<b>276,4</b>	<b>1007,3</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	6,0 %	5,7 %	5,7 %	5,8 %
15-35	3,6 %	6,2 %	5,7 %	5,8 %
36-60	6,1 %	6,1 %	5,1 %	5,5 %
61-90	-	5,6 %	4,4 %	5,5 %
91-180	-	5,7 %	4,7 %	4,9 %
>180	-	5,4 %	4,5 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,7 %</b>	<b>5,7 %</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	22 al 26 de Junio				29 de Jun. al 3 de Julio				6 al 10 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	26	1736	1697	11	22	1461	1180	9	21	924	1114
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	883	530	0	0	753	656	0	0	799	212
<b>Otros</b>	26	10	583	974	22	11	245	623	21	9	165	562
<b>Total</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>3201</b>	<b>3201</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>2458</b>	<b>2458</b>	<b>30</b>	<b>30</b>	<b>1888</b>	<b>1888</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