

**Fecha de Publicación: 30 de Junio de 2009**  
**Fecha de Información: 25 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\$957,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	109,7	239,6	160,0	0,0	52,8	82,9	322,5
15-35	268,8	343,1	263,0	58,1	28,1	158,7	559,9
36-60	13,2	6,6	0,0	0,0	6,6	13,2	19,8
61-90	25,0	21,2	0,0	0,0	6,2	10,0	31,2
91-180	2,2	6,7	0,0	1,0	6,7	1,2	8,9
>180	0,0	15,2	15,0	0,0	0,2	0,0	15,2
<b>Total</b>	<b>418,8</b>	<b>632,5</b>	<b>438,0</b>	<b>59,1</b>	<b>100,8</b>	<b>265,9</b>	<b>957,6</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,7 %	4,5 %	4,5 %	4,7 %
15-35	6,3 %	5,1 %	5,6 %	5,4 %
36-60	-	5,6 %	5,7 %	5,6 %
61-90	5,5 %	5,6 %	5,2 %	5,4 %
91-180	-	5,5 %	5,0 %	5,4 %
>180	-	5,2 %	-	5,2 %
<b>Total</b>	<b>6,0 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>5,3 %</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	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>	11	27	1764	1723	13	23	1647	1522	10	22	1062	1180
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	883	530	0	0	933	656	0	0	799	247
<b>Otros</b>	27	11	609	1003	23	13	317	718	22	10	166	601
<b>Total</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>3256</b>	<b>3256</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>2896</b>	<b>2896</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>2027</b>	<b>2027</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 intragruppo