

Fecha de Publicación: 3 de Julio de 2009  
 Fecha de Información: 01 de Julio 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\$534,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	143,5	67,0	34,2	66,6	-	44,0	177,6
15-35	185,6	146,9	99,4	143,1	5,0	-	290,0
36-60	35,7	5,8	5,8	35,7	-	-	41,5
61-90	3,0	2,4	2,0	2,6	-	-	4,9
91-180	14,2	12,6	2,6	4,2	-	-	16,8
>180	0,0	3,6	3,6	0,0	-	-	3,6
<b>Total</b>	<b>382,0</b>	<b>238,3</b>	<b>147,6</b>	<b>252,2</b>	<b>5,0</b>	<b>44,0</b>	<b>534,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,6 %	6,1 %	4,0 %	4,9 %
15-35	5,6 %	5,6 %	5,9 %	5,8 %
36-60	-	5,7 %	5,2 %	5,3 %
61-90	5,4 %	4,9 %	5,6 %	5,3 %
91-180	5,5 %	5,7 %	9,3 %	6,5 %
>180	-	5,5 %	-	5,5 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>5,7 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>5,5 %</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
<b>Sector Financiero**</b>	13	23	1747	1541	11	27	1566	1402	8	35	1202	1136
<b>Otros***</b>	23	13	961	1205	27	11	890	957	35	8	887	1026
<b>Intragrupo</b>	0	0	307	270	0	0	238	335	0	0	91	19
<b>Total</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>3016</b>	<b>3016</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>2694</b>	<b>2694</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>2180</b>	<b>2180</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Otros agentes sin intragrupo

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo