

**Fecha de Publicación: 06 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 02 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\$661,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.<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	117,8	136,7	65,5	69,7	30,0	7,0	213,3
15-35	146,0	290,2	189,2	91,5	46,5	-	381,8
36-60	11,9	2,1	2,1	11,9	-	-	14,0
61-90	0,2	23,5	23,5	0,2	-	-	23,7
91-180	0,8	24,3	24,3	0,8	-	-	25,1
>180	0,0	3,0	3,0	0,0	-	-	3,0
<b>Total</b>	<b>276,7</b>	<b>479,9</b>	<b>307,7</b>	<b>174,1</b>	<b>76,5</b>	<b>7,0</b>	<b>661,0</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	5,1 %	6,1 %	5,6 %	5,7 %
15-35	6,2 %	6,1 %	5,4 %	5,9 %
36-60	-	6,0 %	5,4 %	5,5 %
61-90	-	5,8 %	4,9 %	5,7 %
91-180	-	5,8 %	4,9 %	5,7 %
>180	-	5,4 %	-	5,4 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>5,8 %</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	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	23	1748	1541	11	29	1617	1516	8	35	1269	1164
Otros***	23	13	961	1205	29	11	953	980	35	8	896	1073
Intragrupo	0	0	307	270	0	0	268	342	0	0	91	19
<b>Total</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>3016</b>	<b>3016</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>2838</b>	<b>2838</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>2256</b>	<b>2256</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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo