

**Fecha de Publicación: 9 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 07 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\$699,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.<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         | 188,7               | 77,1         | 22,7                      | 64,0        | 33,1          | 103,5        | 244,6        |
| 15-35        | 163,7               | 290,4        | 192,8                     | 28,0        | 53,0          | 91,0         | 409,4        |
| 36-60        | 28,8                | 2,1          | 0,0                       | 0,0         | 2,1           | 28,8         | 30,9         |
| 61-90        | 0,0                 | 1,1          | 0,0                       | 0,0         | 1,1           | 0,0          | 1,1          |
| 91-180       | 0,0                 | 9,3          | 0,0                       | 0,0         | 9,3           | 0,0          | 9,3          |
| >180         | 0,0                 | 4,0          | 0,0                       | 0,0         | 4,0           | 0,0          | 4,0          |
| <b>Total</b> | <b>381,3</b>        | <b>384,1</b> | <b>215,5</b>              | <b>92,0</b> | <b>102,6</b>  | <b>223,3</b> | <b>699,4</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         | 6,2 %              | 5,9 %                        | 6,2 %        | 6,2 %        |
| 15-35        | 6,1 %              | 6,3 %                        | 5,7 %        | 6,1 %        |
| 36-60        | -                  | 6,2 %                        | 5,5 %        | 5,6 %        |
| 61-90        | 5,7 %              | 6,3 %                        | -            | 6,3 %        |
| 91-180       | -                  | 5,5 %                        | -            | 5,5 %        |
| >180         | -                  | 5,5 %                        | -            | 5,5 %        |
| <b>Total</b> | <b>6,1 %</b>       | <b>6,2 %</b>                 | <b>5,9 %</b> | <b>6,1 %</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                           | 6 al 10 de Julio |           |             |             | 13 al 17 de Julio |           |             |             | 20 al 24 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               | 31        | 1824        | 1867        | 14                | 34        | 1547        | 1298        | 1                 | 26        | 819         | 1082        |
| <b>Intragrupa y off-shore***</b> | 0                | 0         | 1162        | 580         | 0                 | 0         | 666         | 354         | 0                 | 0         | 768         | 237         |
| <b>Otros</b>                     | 31               | 11        | 344         | 883         | 34                | 14        | 400         | 960         | 26                | 1         | 205         | 473         |
| <b>Total</b>                     | <b>41</b>        | <b>41</b> | <b>3330</b> | <b>3330</b> | <b>48</b>         | <b>48</b> | <b>2612</b> | <b>2612</b> | <b>28</b>         | <b>28</b> | <b>1792</b> | <b>1792</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