

**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**		Intragruppo 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 intragruppo		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**

Sectores	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>Intragruppo 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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo