

**Fecha de Publicación: 10 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 08 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\$810,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.<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	249,6	201,0	34,0	92,0	116,7	107,3	400,4
15-35	186,8	211,6	153,0	25,0	32,6	135,8	372,3
36-60	1,7	19,8	18,0	0,0	1,8	1,7	21,5
61-90	10,4	0,3	0,0	10,0	0,3	0,4	10,7
91-180	0,4	1,3	0,0	0,0	1,3	0,4	1,7
>180	3,0	1,0	0,0	0,0	1,0	3,0	4,0
<b>Total</b>	<b>452,0</b>	<b>435,0</b>	<b>205,0</b>	<b>127,0</b>	<b>153,6</b>	<b>248,7</b>	<b>810,6</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,3 %	5,9 %	5,3 %	5,7 %
15-35	4,2 %	5,2 %	5,0 %	5,0 %
36-60	-	6,0 %	5,7 %	6,0 %
61-90	-	6,2 %	5,8 %	5,8 %
91-180	-	5,5 %	5,2 %	5,4 %
>180	-	5,7 %	5,0 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,4 %</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
Sector Financiero**	11	32	1824	1866	15	34	1790	1497	1	26	826	1101
Intragruppo y off-shore***	0	0	1162	580	0	0	700	444	0	0	783	239
Otros	32	11	343	883	34	15	514	1063	26	1	209	479
<b>Total</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>3329</b>	<b>3329</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>3004</b>	<b>3004</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>1818</b>	<b>1818</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 intragrupo