

**Fecha de Publicación: 17 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 15 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\$711,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<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	278,2	58,9	13,7	203,6	45,0	74,4	337,0
15-35	168,7	69,5	42,0	71,4	10,5	80,3	221,1
36-60	36,7	4,8	0,0	0,0	4,7	36,7	41,4
61-90	0,9	3,9	0,0	0,0	3,9	0,9	4,8
91-180	0,9	71,4	55,0	0,0	16,4	0,9	72,4
>180	0,0	35,1	0,0	0,0	35,1	0,0	35,1
<b>Total</b>	<b>485,4</b>	<b>243,6</b>	<b>110,8</b>	<b>275,0</b>	<b>115,6</b>	<b>193,2</b>	<b>711,8</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	5,4 %	4,9 %	4,4 %	4,6 %
15-35	5,5 %	5,5 %	5,5 %	5,5 %
36-60	-	6,3 %	5,6 %	5,7 %
61-90	-	6,0 %	5,2 %	5,9 %
91-180	-	6,8 %	5,4 %	6,7 %
>180	-	5,4 %	4,8 %	5,4 %
<b>Total</b>	<b>5,5 %</b>	<b>5,6 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,3 %</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	13 al 17 de Julio				20 al 24 de Julio				27 al 31 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	31	2323	2068	2	29	1024	1223	14	25	924	1129
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1050	705	0	0	822	277	0	0	571	108
<b>Otros</b>	31	13	632	1231	29	2	292	638	25	14	353	611
<b>Total</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>4004</b>	<b>4004</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2138</b>	<b>2138</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>1848</b>	<b>1848</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 intragruppo