

**Fecha de Publicación: 4 de Junio de 2009**  
**Fecha de Información: 02 de Junio 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\$678,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	220,3	73,1	0,0	103,0	46,1	90,2	266,4
15-35	161,8	106,4	55,3	71,0	45,9	85,6	263,0
36-60	20,8	36,4	20,0	0,0	16,4	20,8	57,2
61-90	25,9	43,0	14,0	0,0	9,0	5,9	48,9
91-180	1,3	21,0	10,0	0,0	11,0	1,3	22,3
>180	5,1	20,5	10,0	0,0	5,5	0,1	20,6
<b>Total</b>	<b>435,2</b>	<b>300,4</b>	<b>109,3</b>	<b>174,0</b>	<b>133,9</b>	<b>203,9</b>	<b>678,4</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	5,6 %	3,2 %	4,6 %	4,4 %
15-35	7,2 %	5,8 %	5,5 %	5,6 %
36-60	-	5,8 %	5,3 %	5,5 %
61-90	2,8 %	5,8 %	4,6 %	4,4 %
91-180	-	5,1 %	3,7 %	5,0 %
>180	4,9 %	5,0 %	4,3 %	5,0 %
<b>Total</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,1 %</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	1 al 5 de Junio				8 al 12 de Junio				15 al 19 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	8	26	1426	1372	9	27	1741	1610	13	27	835	975
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	2	880	552	0	1	1071	880	0	0	554	288
<b>Otros</b>	26	6	331	713	27	8	278	600	27	13	252	378
<b>Total</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2637</b>	<b>2637</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>3090</b>	<b>3090</b>	<b>41</b>	<b>41</b>	<b>1640</b>	<b>1640</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