

**Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2009**  
**Fecha de Información: 24 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\$821,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	190,9	94,1	44,0	90,3	29,9	80,5	264,8
15-35	271,7	182,8	20,0	111,3	85,8	83,4	377,5
36-60	34,2	3,1	0,0	7,0	3,1	27,2	37,4
61-90	11,2	19,0	15,0	0,0	3,8	10,9	30,0
91-180	21,1	100,9	70,0	0,0	10,9	1,1	102,1
>180	1,0	10,0	0,0	0,0	9,0	0,0	10,0
<b>Total</b>	<b>530,1</b>	<b>410,0</b>	<b>149,0</b>	<b>208,6</b>	<b>142,6</b>	<b>203,2</b>	<b>821,7</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	4,5 %	5,4 %	4,4 %	4,7 %
15-35	4,7 %	5,3 %	4,9 %	5,0 %
36-60	-	5,4 %	4,6 %	4,7 %
61-90	4,1 %	6,1 %	4,6 %	5,5 %
91-180	5,3 %	5,5 %	4,5 %	5,4 %
>180	5,3 %	5,5 %	-	5,5 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,0 %</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	20 al 24 de Julio				27 al 31 de Julio				3 al 7 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	3	35	1378	1342	12	31	1642	1473	6	19	1230	1290
Intragruppo y off-shore***	0	0	852	488	0	0	760	329	0	0	732	268
Otros	35	3	351	751	31	12	471	1071	19	6	272	676
<b>Total</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>2581</b>	<b>2581</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>2873</b>	<b>2873</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>2234</b>	<b>2234</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