

Fecha de Publicación: 29 de Julio de 2009  
 Fecha de Información: 27 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\$633,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	157,2	133,6	86,6	67,8	46,9	89,3	290,7
15-35	177,4	134,9	98,0	31,9	6,1	114,7	281,5
36-60	15,3	6,4	0,0	0,0	6,4	15,3	21,6
61-90	0,4	0,3	0,0	0,0	0,3	0,4	0,7
91-180	14,3	20,2	2,5	0,0	17,7	14,3	34,5
>180	3,3	4,4	0,0	0,0	1,1	0,0	4,4
<b>Total</b>	<b>367,8</b>	<b>299,7</b>	<b>187,1</b>	<b>99,7</b>	<b>78,5</b>	<b>234,0</b>	<b>633,5</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	5,2 %	4,4 %	7,2 %	6,2 %
15-35	4,2 %	4,8 %	3,9 %	4,2 %
36-60	-	4,7 %	4,3 %	4,4 %
61-90	-	7,5 %	4,2 %	5,7 %
91-180	-	5,4 %	4,4 %	5,0 %
>180	4,7 %	5,3 %	4,1 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,3 %</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	27 al 31 de Julio				3 al 7 de Agosto				10 al 14 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	31	1718	1589	6	19	1304	1307	6	101	1275	1026
Intragruppo y off-shore***	0	0	847	357	0	0	732	308	0	0	580	325
Otros	31	12	500	1120	19	6	289	710	100	6	259	764
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>3065</b>	<b>3065</b>	<b>25</b>	<b>25</b>	<b>2325</b>	<b>2325</b>	<b>106</b>	<b>106</b>	<b>2114</b>	<b>2114</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo