

**Fecha de Publicación: 5 de Agosto de 2009**  
**Fecha de Información: 03 de Agosto 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\$787,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	212,3	157,0	124,2	16,4	22,8	185,9	359,3
15-35	200,3	191,9	116,6	10,0	42,3	157,3	359,2
36-60	26,5	26,1	22,0	0,0	4,1	26,5	52,6
61-90	1,0	0,2	0,0	0,0	0,2	1,0	1,3
91-180	2,6	12,6	10,0	0,0	2,6	2,6	15,1
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>442,7</b>	<b>387,8</b>	<b>272,8</b>	<b>26,4</b>	<b>72,0</b>	<b>373,3</b>	<b>787,5</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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	3,7 %	4,8 %	4,2 %	4,2 %
15-35	4,4 %	4,4 %	3,9 %	4,1 %
36-60	-	5,5 %	4,1 %	4,8 %
61-90	-	6,3 %	3,8 %	4,2 %
91-180	-	4,8 %	4,3 %	4,7 %
>180	-	6,2 %	-	6,2 %
<b>Total</b>	<b>4,2 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>4,2 %</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**

Sector	3 al 7 de Agosto										10 al 14 de Agosto				17 al 21 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
<b>Sector Financiero**</b>	11	20	1773	1713	8	103	1615	1320	5	21	916	1039						
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	2	931	487	0	1	763	340	0	0	649	158						
<b>Otros</b>	20	9	436	939	103	7	317	1036	21	5	239	607						
<b>Total</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>3139</b>	<b>3139</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>2695</b>	<b>2695</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>1804</b>	<b>1804</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