

**Fecha de Publicación: 10 de Agosto de 2009**  
**Fecha de Información: 05 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\$730,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<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	144,7	67,9	10,0	27,1	37,6	97,2	192,2
15-35	182,6	315,2	207,3	22,0	76,6	129,3	466,5
36-60	29,9	19,5	0,0	0,0	19,5	29,9	49,3
61-90	7,5	4,4	0,0	5,0	4,3	2,4	11,8
91-180	0,2	5,1	0,0	0,0	5,0	0,2	5,3
>180	0,0	4,9	0,0	0,0	4,9	0,0	4,9
<b>Total</b>	<b>364,8</b>	<b>416,8</b>	<b>217,3</b>	<b>54,1</b>	<b>147,9</b>	<b>259,1</b>	<b>730,0</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	4,0 %	4,1 %	3,7 %	3,9 %
15-35	1,6 %	4,7 %	3,9 %	4,2 %
36-60	-	4,9 %	4,0 %	4,3 %
61-90	4,8 %	5,0 %	4,0 %	4,4 %
91-180	4,9 %	5,2 %	3,8 %	5,1 %
>180	-	5,2 %	-	5,2 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,9 %</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	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	21	1826	1715	8	102	1834	1504	5	21	979	1080
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	2	931	508	0	2	833	367	0	0	649	172
<b>Otros</b>	21	9	437	972	102	7	396	1193	21	5	280	656
<b>Total</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>3194</b>	<b>3194</b>	<b>111</b>	<b>111</b>	<b>3064</b>	<b>3064</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>1908</b>	<b>1908</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo