

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2009  
 Fecha de Información: 13 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\$709,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	201,0	203,9	54,6	0,5	65,1	116,4	320,8
15-35	223,0	161,8	77,5	91,0	26,3	74,0	326,8
36-60	26,9	10,4	7,0	0,0	3,4	26,9	37,3
61-90	0,0	5,5	0,0	0,0	5,5	0,0	5,5
91-180	2,3	7,0	0,5	0,0	6,5	2,3	9,3
>180	5,0	4,3	0,0	0,0	4,3	5,0	9,3
<b>Total</b>	<b>458,2</b>	<b>392,9</b>	<b>139,6</b>	<b>91,5</b>	<b>111,2</b>	<b>224,6</b>	<b>709,0</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	2,8 %	4,7 %	4,3 %	3,9 %
15-35	3,7 %	4,8 %	4,3 %	4,3 %
36-60	-	4,7 %	4,6 %	4,6 %
61-90	-	5,7 %	4,0 %	5,6 %
91-180	-	5,2 %	4,8 %	5,1 %
>180	-	4,9 %	4,7 %	4,8 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,3 %</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**

Sectores	10 al 14 de Agosto				17 al 21 de Agosto				24 al 28 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	41	2001	1835	6	32	1325	1347	11	26	1393	1262
Intragrupa y off-shore***	0	2	1026	380	0	0	727	198	0	0	580	313
Otros	40	10	524	1336	32	6	401	909	26	11	369	767
<b>Total</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>3551</b>	<b>3551</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>2454</b>	<b>2454</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>2342</b>	<b>2342</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