

**Fecha de Publicación: 21 de Agosto de 2009**  
**Fecha de Información: 19 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\$908,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<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	349,4	218,7	7,5	165,2	179,1	152,1	536,0
15-35	152,2	248,3	134,0	57,0	56,3	37,2	342,5
36-60	0,6	4,5	3,0	0,0	1,5	0,6	5,1
61-90	1,4	2,4	0,0	0,0	2,4	1,4	3,8
91-180	2,0	4,1	0,0	0,0	4,1	2,0	6,2
>180	2,5	12,4	0,0	0,0	12,4	2,5	14,9
<b>Total</b>	<b>508,1</b>	<b>490,5</b>	<b>144,5</b>	<b>222,1</b>	<b>255,8</b>	<b>195,8</b>	<b>908,4</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	5,6 %	4,0 %	3,6 %	4,0 %
15-35	5,0 %	5,3 %	4,5 %	5,0 %
36-60	-	5,0 %	4,0 %	4,9 %
61-90	-	4,9 %	4,3 %	4,7 %
91-180	-	5,1 %	4,8 %	5,0 %
>180	-	6,0 %	4,7 %	5,8 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,5 %</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	17 al 21 de Agosto				24 al 28 de Agosto				31 de Ago. al 4 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	6	36	1583	1623	13	28	1847	1651	5	21	1178	1307
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	7	0	839	243	0	1	599	464	0	0	661	258
<b>Otros</b>	28	6	497	1053	28	11	650	982	21	5	443	718
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>2919</b>	<b>2919</b>	<b>41</b>	<b>41</b>	<b>3097</b>	<b>3097</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>2283</b>	<b>2283</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