

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2009  
 Fecha de Información: 20 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\$1141,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.<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	145,7	213,2	122,0	84,0	90,8	61,3	358,6
15-35	350,1	408,1	274,0	56,3	56,1	215,8	680,2
36-60	41,3	11,5	8,7	0,0	2,8	41,3	52,8
61-90	0,7	10,1	5,0	0,0	4,6	0,2	10,3
91-180	2,0	14,1	0,0	0,0	14,1	2,0	16,1
>180	0,0	23,2	0,0	0,0	23,2	0,0	23,2
<b>Total</b>	<b>539,8</b>	<b>680,2</b>	<b>409,7</b>	<b>140,3</b>	<b>191,6</b>	<b>320,6</b>	<b>1141,1</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	4,9 %	5,1 %	2,0 %	3,7 %
15-35	4,8 %	5,3 %	5,0 %	5,1 %
36-60	-	5,1 %	4,6 %	4,7 %
61-90	4,8 %	5,0 %	4,0 %	4,9 %
91-180	-	5,1 %	4,7 %	5,1 %
>180	-	5,4 %	-	5,4 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,8 %</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
Sector Financiero**	6	35	1603	1621	10	29	1965	1803	5	21	1189	1378
Intragrupa y off-shore***	7	0	839	243	0	1	697	541	0	0	696	265
Otros	28	6	495	1073	29	8	704	1021	21	5	479	721
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>2937</b>	<b>2937</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>3366</b>	<b>3366</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>2364</b>	<b>2364</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