

Fecha de Publicación: 2 de Septiembre de 2009  
 Fecha de Información: 31 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\$815,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.<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	202,7	146,6	53,2	138,0	83,2	54,5	339,1
15-35	205,4	179,1	118,8	92,5	20,8	73,3	344,9
36-60	20,3	76,9	71,8	5,0	5,2	15,3	97,2
61-90	23,5	0,2	0,0	0,0	0,2	23,5	23,7
91-180	2,7	6,3	0,0	0,0	6,3	2,7	9,0
>180	1,1	0,8	0,0	0,0	0,8	1,1	1,8
<b>Total</b>	<b>455,7</b>	<b>410,0</b>	<b>243,8</b>	<b>235,5</b>	<b>116,4</b>	<b>170,4</b>	<b>815,9</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	4,5 %	5,0 %	4,3 %	4,6 %
15-35	4,4 %	5,2 %	4,7 %	4,8 %
36-60	-	5,0 %	4,0 %	4,7 %
61-90	-	5,2 %	4,3 %	4,3 %
91-180	-	5,2 %	4,3 %	4,9 %
>180	-	5,2 %	4,3 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>4,4 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,7 %</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	31 de Ago. al 4 de Septiembre				7 al 11 de Septiembre				14 al 18 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	19	1838	2001	6	23	1081	1053	10	32	1279	1367
Intragrupa y off-shore***	0	0	1012	542	0	0	711	283	0	0	988	543
Otros	19	5	702	1009	23	6	194	650	32	10	182	539
<b>Total</b>	<b>24</b>	<b>24</b>	<b>3552</b>	<b>3552</b>	<b>29</b>	<b>29</b>	<b>1986</b>	<b>1986</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>2449</b>	<b>2449</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