

**Fecha de Publicación: 8 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 04 de Septiembre 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\$555,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.<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	176,8	67,3	0,0	49,0	37,3	97,8	214,1
15-35	132,9	152,4	68,1	35,3	51,3	64,7	252,3
36-60	23,3	11,8	8,0	0,0	3,8	23,3	35,1
61-90	8,2	1,1	0,0	0,0	1,1	8,2	9,2
91-180	0,5	5,0	0,0	0,0	5,0	0,5	5,5
>180	0,0	39,3	0,0	0,0	39,3	0,0	39,3
<b>Total</b>	<b>341,7</b>	<b>276,8</b>	<b>76,1</b>	<b>84,3</b>	<b>137,7</b>	<b>194,4</b>	<b>555,5</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	5,4 %	5,0 %	4,3 %	4,6 %
15-35	4,9 %	5,3 %	4,9 %	5,1 %
36-60	-	5,4 %	4,3 %	4,7 %
61-90	-	5,7 %	4,7 %	4,8 %
91-180	-	5,4 %	4,1 %	5,3 %
>180	-	5,1 %	-	5,1 %
<b>Total</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,9 %</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		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
<b>Sector Financiero**</b>	7	20	1999	2059	10	25	1584	1455	16	33	1665	1762						
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1017	635	0	0	836	550	0	0	1264	782						
<b>Otros</b>	19	7	755	1076	24	10	441	857	33	16	246	630						
<b>Total</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>3770</b>	<b>3770</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2862</b>	<b>2862</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>3175</b>	<b>3175</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo