

**Fecha de Publicación: 19 de Agosto de 2009**  
**Fecha de Información: 14 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\$1033,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	256,2	393,4	109,0	10,0	143,7	105,4	508,8
15-35	219,6	196,6	116,0	25,0	72,5	186,4	408,0
36-60	15,1	7,3	0,0	0,0	7,3	15,1	22,4
61-90	35,5	36,3	0,0	0,0	36,3	35,5	71,8
91-180	3,8	6,6	0,0	0,0	6,6	3,8	10,4
>180	10,1	1,9	0,0	0,0	1,9	10,1	12,0
<b>Total</b>	<b>540,2</b>	<b>642,2</b>	<b>225,0</b>	<b>35,0</b>	<b>268,3</b>	<b>356,3</b>	<b>1033,6</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,6 %	4,9 %	4,2 %	4,6 %
15-35	4,7 %	4,7 %	4,0 %	4,3 %
36-60	-	5,0 %	4,2 %	4,5 %
61-90	-	4,5 %	4,5 %	4,5 %
91-180	-	5,5 %	3,2 %	4,6 %
>180	-	6,0 %	3,0 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,1 %</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**

Sector	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
<b>Sector Financiero**</b>	12	41	2001	1834	6	33	1462	1584	11	27	1515	1420
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	2	1026	380	7	0	836	198	0	0	580	323
<b>Otros</b>	41	10	523	1336	25	6	461	978	27	11	455	807
<b>Total</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>3551</b>	<b>3551</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>2759</b>	<b>2759</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>2550</b>	<b>2550</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 intragruppo