

**Fecha de Publicación: 14 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 10 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\$655,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.<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	130,7	111,6	25,5	52,0	85,9	78,5	242,1
15-35	187,5	218,9	173,5	59,6	15,4	97,9	376,4
36-60	2,4	9,4	2,4	0,0	7,0	2,4	11,8
61-90	8,1	1,8	0,0	0,0	1,8	8,1	10,0
91-180	0,0	10,5	0,0	0,0	10,5	0,0	10,5
>180	0,0	4,5	0,0	0,0	4,5	0,0	4,5
<b>Total</b>	<b>328,7</b>	<b>356,7</b>	<b>201,4</b>	<b>111,6</b>	<b>125,1</b>	<b>186,9</b>	<b>655,2</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	5,5 %	5,5 %	4,7 %	5,1 %
15-35	5,2 %	5,3 %	4,9 %	5,1 %
36-60	-	5,3 %	4,2 %	5,0 %
61-90	-	6,4 %	5,0 %	5,2 %
91-180	-	5,6 %	-	5,6 %
>180	-	5,2 %	-	5,2 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>5,1 %</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	7 al 11 de Septiembre						14 al 18 de Septiembre						21 al 25 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		
Sector Financiero**	11	25	1696	1513	18	40	2215	2104	8	32	1163	1466						
Intragrupa y off-shore***	0	0	836	616	5	0	1354	1047	0	0	864	349						
Otros	25	11	484	887	35	18	468	886	32	8	337	549						
<b>Total</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>3016</b>	<b>3016</b>	<b>58</b>	<b>58</b>	<b>4037</b>	<b>4037</b>	<b>39</b>	<b>39</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo