

Fecha de Publicación: 18 de Septiembre de 2009  
 Fecha de Información: 16 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\$881,8 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	335,4	97,6	0,0	192,5	77,6	122,9	413,0
15-35	175,3	222,4	208,1	118,5	6,2	48,8	389,7
36-60	1,2	12,7	0,0	0,0	12,7	1,2	13,9
61-90	8,5	13,6	0,0	0,0	13,6	8,5	22,0
91-180	10,3	26,8	0,1	10,0	26,6	0,2	37,1
>180	2,0	4,1	0,0	0,0	4,1	2,0	6,1
<b>Total</b>	<b>532,8</b>	<b>377,1</b>	<b>208,2</b>	<b>321,0</b>	<b>140,8</b>	<b>183,6</b>	<b>881,8</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	5,1 %	5,2 %	4,3 %	4,6 %
15-35	4,6 %	5,1 %	4,9 %	5,0 %
36-60	-	5,6 %	4,1 %	5,4 %
61-90	-	5,7 %	5,1 %	5,5 %
91-180	5,3 %	5,5 %	5,1 %	5,4 %
>180	-	5,7 %	4,9 %	5,5 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>4,6 %</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	14 al 18 de Septiembre				21 al 25 de Septiembre				28 de Sep. al 2 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	21	38	2548	2273	28	39	1613	1711	7	36	1320	1601
Intragrupa y off-shore***	5	0	1455	1276	0	0	903	548	5	0	1042	388
Otros	33	21	525	980	39	28	482	740	31	7	301	674
<b>Total</b>	<b>59</b>	<b>59</b>	<b>4529</b>	<b>4529</b>	<b>67</b>	<b>67</b>	<b>2999</b>	<b>2999</b>	<b>43</b>	<b>43</b>	<b>2663</b>	<b>2663</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