

**Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 21 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\$514,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.<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	81,9	104,3	28,1	45,0	61,1	21,9	171,2
15-35	174,8	141,3	56,0	71,3	6,8	25,0	237,6
36-60	33,5	17,5	0,0	0,0	9,5	25,5	43,0
61-90	16,7	2,4	0,0	0,0	2,4	16,7	19,1
91-180	18,8	18,4	10,0	0,0	8,4	18,8	37,2
>180	0,1	6,6	0,0	0,0	6,6	0,1	6,7
<b>Total</b>	<b>325,7</b>	<b>290,5</b>	<b>94,1</b>	<b>116,3</b>	<b>94,8</b>	<b>108,0</b>	<b>514,7</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 %	5,0 %	4,5 %	4,9 %
15-35	4,1 %	5,3 %	4,8 %	4,6 %
36-60	4,9 %	5,4 %	4,8 %	5,0 %
61-90	-	5,8 %	4,8 %	4,9 %
91-180	-	5,2 %	4,9 %	5,0 %
>180	-	5,2 %	2,5 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>4,3 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,8 %</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	21 al 25 de Septiembre				28 de Sep. al 2 de Octubre				5 al 9 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	44	41	1918	2022	7	48	1424	1775	41	28	1194	1331
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	1	1000	672	5	0	1096	420	0	0	819	267
<b>Otros</b>	41	43	636	861	43	7	396	721	28	41	224	639
<b>Total</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>3555</b>	<b>3555</b>	<b>55</b>	<b>55</b>	<b>2916</b>	<b>2916</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>2236</b>	<b>2236</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