

**Fecha de Publicación: 24 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 22 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\$788,5 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	181,6	164,6	26,1	113,7	138,1	67,5	345,9
15-35	171,5	187,1	106,0	68,4	30,1	52,1	307,6
36-60	38,3	2,6	0,0	0,0	2,6	38,3	40,9
61-90	40,1	5,7	0,0	14,9	5,7	25,2	45,8
91-180	12,0	24,5	15,0	0,0	9,5	12,0	36,5
>180	3,5	8,3	0,0	0,0	8,3	3,5	11,8
<b>Total</b>	<b>447,0</b>	<b>392,8</b>	<b>147,1</b>	<b>197,0</b>	<b>194,3</b>	<b>198,6</b>	<b>788,5</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	4,7 %	5,2 %	4,0 %	4,6 %
15-35	5,2 %	5,2 %	4,4 %	4,9 %
36-60	-	5,5 %	4,9 %	4,9 %
61-90	-	5,6 %	4,7 %	4,8 %
91-180	-	5,3 %	4,7 %	5,1 %
>180	-	5,3 %	5,0 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>4,3 %</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>	42	44	1984	2060	26	49	1515	1886	41	28	1232	1368
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	4	1	1000	708	5	0	1118	493	0	0	819	271
<b>Otros</b>	40	40	673	891	44	26	485	739	28	41	261	672
<b>Total</b>	<b>85</b>	<b>85</b>	<b>3658</b>	<b>3658</b>	<b>76</b>	<b>76</b>	<b>3118</b>	<b>3118</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2311</b>	<b>2311</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