

**Fecha de Publicación: 28 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 24 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\$827,9 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	236,6	133,9	24,0	115,0	87,7	99,5	348,3
15-35	125,5	341,4	298,5	28,0	2,4	57,0	426,4
36-60	9,3	12,9	0,0	0,0	12,9	9,3	22,2
61-90	23,7	2,2	0,0	6,5	2,2	17,2	26,0
91-180	2,0	2,8	0,0	0,0	2,8	2,0	4,8
>180	0,0	0,1	0,0	0,0	0,1	0,0	0,1
<b>Total</b>	<b>397,2</b>	<b>493,3</b>	<b>322,5</b>	<b>149,5</b>	<b>108,2</b>	<b>185,1</b>	<b>827,9</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 %	4,7 %	4,9 %
15-35	4,8 %	5,1 %	4,7 %	5,0 %
36-60	-	5,2 %	4,8 %	5,0 %
61-90	-	5,3 %	4,8 %	4,9 %
91-180	-	6,0 %	5,0 %	5,6 %
>180	-	5,7 %	-	5,7 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,7 %</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	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
Sector Financiero**	62	43	2049	2060	12	49	1915	2119	41	28	1340	1474
Intragrupa y off-shore***	4	1	1000	770	5	0	1138	695	0	0	850	311
Otros	39	60	674	893	44	12	635	875	28	41	336	740
<b>Total</b>	<b>105</b>	<b>105</b>	<b>3724</b>	<b>3724</b>	<b>61</b>	<b>61</b>	<b>3689</b>	<b>3689</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>2525</b>	<b>2525</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