

**Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2009**  
**Fecha de Información: 25 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\$697,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	173,7	107,3	60,0	60,0	47,2	113,6	280,9
15-35	158,4	183,8	138,2	48,0	45,6	110,4	342,2
36-60	0,8	11,8	0,0	0,0	11,8	0,8	12,5
61-90	10,3	4,4	0,0	5,1	4,4	5,2	14,7
91-180	24,3	16,6	0,0	0,0	16,6	24,3	40,9
>180	5,0	1,2	0,0	0,0	1,2	5,0	6,3
<b>Total</b>	<b>372,5</b>	<b>325,2</b>	<b>198,2</b>	<b>113,1</b>	<b>126,9</b>	<b>259,3</b>	<b>697,6</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 %	5,7 %	4,7 %	4,9 %
15-35	-	5,2 %	4,7 %	5,0 %
36-60	-	6,7 %	4,4 %	6,5 %
61-90	-	6,3 %	4,8 %	5,2 %
91-180	-	5,3 %	4,8 %	5,0 %
>180	-	5,7 %	5,1 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>5,1 %</b>	<b>5,4 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>5,0 %</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	2061	13	60	1977	2200	41	28	1452	1490
Intragrupa y off-shore***	4	1	1000	770	5	0	1198	745	0	0	850	321
Otros	39	60	674	893	55	13	656	886	28	41	351	842
<b>Total</b>	<b>104</b>	<b>104</b>	<b>3724</b>	<b>3724</b>	<b>72</b>	<b>72</b>	<b>3831</b>	<b>3831</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2653</b>	<b>2653</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