

**Fecha de Publicación: 2 de Octubre de 2009**  
**Fecha de Información: 30 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\$735,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	181,2	131,8	20,0	115,3	101,8	55,9	303,0
15-35	149,5	139,1	109,0	84,7	26,1	60,9	284,6
36-60	11,6	8,5	0,0	0,0	8,5	11,6	20,1
61-90	51,0	0,8	0,0	12,4	0,8	38,6	51,8
91-180	6,3	39,2	0,0	0,0	39,2	6,3	45,5
>180	0,0	31,0	20,0	0,0	11,0	0,0	31,0
<b>Total</b>	<b>399,6</b>	<b>350,3</b>	<b>149,0</b>	<b>212,4</b>	<b>187,3</b>	<b>173,2</b>	<b>735,9</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,7 %	4,8 %	3,9 %	4,4 %
15-35	5,0 %	4,9 %	4,6 %	4,7 %
36-60	-	5,0 %	4,3 %	4,6 %
61-90	-	5,9 %	4,5 %	4,5 %
91-180	-	4,9 %	4,5 %	4,8 %
>180	-	5,0 %	4,0 %	5,0 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>4,6 %</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	28 de Sep. al 2 de Octubre				5 al 9 de Octubre				12 al 16 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	14	102	2277	2282	42	28	1818	1791	12	25	979	1175
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	5	0	1198	951	0	0	896	454	0	0	846	297
<b>Otros</b>	97	14	691	933	28	42	485	954	25	12	152	505
<b>Total</b>	<b>116</b>	<b>116</b>	<b>4166</b>	<b>4166</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>3199</b>	<b>3199</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>1976</b>	<b>1976</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 intragruppo