

**Fecha de Publicación: 8 de Octubre de 2009**  
**Fecha de Información: 06 de Octubre 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\$832,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.<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	198,1	223,0	99,8	35,0	72,9	112,9	370,9
15-35	289,3	198,5	118,5	125,0	8,0	92,3	415,8
36-60	19,8	4,5	0,0	0,0	4,5	19,8	24,3
61-90	0,0	4,1	0,0	0,0	4,1	0,0	4,1
91-180	2,5	16,0	0,2	0,0	13,3	0,0	16,0
>180	0,0	1,2	0,0	0,0	1,2	0,0	1,2
<b>Total</b>	<b>509,8</b>	<b>447,2</b>	<b>218,5</b>	<b>160,0</b>	<b>104,0</b>	<b>225,1</b>	<b>832,3</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	5,4 %	3,8 %	4,3 %	4,3 %
15-35	4,3 %	5,1 %	4,5 %	4,7 %
36-60	-	5,0 %	4,4 %	4,5 %
61-90	-	5,7 %	2,4 %	5,7 %
91-180	4,7 %	5,1 %	3,9 %	5,1 %
>180	-	5,5 %	-	5,5 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>4,5 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,5 %</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	5 al 9 de Octubre				12 al 16 de Octubre				19 al 23 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	184	2279	2242	21	25	1229	1438	6	26	1267	1568
Intragrupa y off-shore***	0	0	1103	690	0	0	929	344	0	0	1081	501
Otros	184	11	674	1123	25	21	282	657	26	6	191	470
<b>Total</b>	<b>195</b>	<b>195</b>	<b>4056</b>	<b>4056</b>	<b>47</b>	<b>47</b>	<b>2439</b>	<b>2439</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>2539</b>	<b>2539</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