

**Fecha de Publicación: 9 de Octubre de 2009**  
**Fecha de Información: 07 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\$756,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	143,7	97,4	9,0	33,0	65,3	87,6	218,0
15-35	276,0	182,2	111,8	89,0	43,4	160,0	431,2
36-60	11,2	7,2	1,3	0,0	5,9	11,2	18,4
61-90	17,9	6,7	0,0	0,0	6,7	17,9	24,5
91-180	47,1	14,0	0,0	0,0	9,0	42,1	56,1
>180	6,9	1,6	0,0	6,9	1,6	0,0	8,5
<b>Total</b>	<b>502,7</b>	<b>309,0</b>	<b>122,1</b>	<b>128,9</b>	<b>131,8</b>	<b>318,8</b>	<b>756,7</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	4,6 %	4,3 %	4,2 %	4,3 %
15-35	4,6 %	5,1 %	3,5 %	4,1 %
36-60	-	5,3 %	-0,9 %	1,5 %
61-90	-	5,2 %	1,7 %	2,7 %
91-180	4,8 %	5,3 %	3,5 %	3,9 %
>180	-	5,2 %	-	5,2 %
<b>Total</b>	<b>4,6 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>4,0 %</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**

Sector	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
<b>Sector Financiero**</b>	10	184	2313	2247	25	28	1303	1490	7	28	1332	1623
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1108	723	0	0	929	344	0	0	1090	521
<b>Otros</b>	184	10	674	1124	28	25	325	724	28	7	209	488
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>4095</b>	<b>4095</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>2557</b>	<b>2557</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2631</b>	<b>2631</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