

**Fecha de Publicación: 13 de Octubre de 2009**  
**Fecha de Información: 08 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\$1018,2 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	130,2	151,1	83,8	31,2	61,8	93,6	275,9
15-35	307,6	363,6	237,0	21,7	42,4	201,7	587,0
36-60	43,7	5,3	0,0	0,0	5,3	43,7	49,0
61-90	28,1	15,5	0,0	0,0	5,5	18,1	33,5
91-180	56,2	13,5	0,0	0,0	13,5	56,2	69,7
>180	0,4	2,6	0,0	0,0	2,6	0,4	3,0
<b>Total</b>	<b>566,2</b>	<b>551,6</b>	<b>320,8</b>	<b>52,9</b>	<b>131,2</b>	<b>413,7</b>	<b>1018,2</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 %	4,8 %	4,4 %	4,6 %
15-35	3,6 %	5,0 %	4,4 %	4,5 %
36-60	-	5,7 %	4,3 %	4,4 %
61-90	4,2 %	5,3 %	4,5 %	4,5 %
91-180	-	5,3 %	4,4 %	4,6 %
>180	-	5,0 %	4,6 %	4,9 %
<b>Total</b>	<b>3,7 %</b>	<b>5,0 %</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**

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	2248	25	31	1382	1614	7	30	1404	1651
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1108	723	0	0	1006	375	0	0	1096	521
<b>Otros</b>	184	10	674	1125	31	25	372	771	30	7	226	554
<b>Total</b>	<b>194</b>	<b>194</b>	<b>4096</b>	<b>4096</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>2759</b>	<b>2759</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>2725</b>	<b>2725</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