

**Fecha de Publicación: 23 de Octubre de 2009**  
**Fecha de Información: 21 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\$924,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.<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	220,4	128,1	53,2	106,5	69,9	108,9	343,6
15-35	226,8	178,2	151,0	103,8	6,7	102,5	384,5
36-60	20,1	101,5	55,0	0,0	46,5	20,1	121,6
61-90	3,9	2,6	0,0	0,0	2,6	3,9	6,5
91-180	30,3	13,6	0,0	0,0	3,6	20,3	33,9
>180	15,2	23,8	15,0	0,0	3,8	10,2	34,0
<b>Total</b>	<b>516,8</b>	<b>447,8</b>	<b>274,2</b>	<b>210,3</b>	<b>133,1</b>	<b>266,0</b>	<b>924,1</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	3,4 %	3,9 %	3,7 %	3,7 %
15-35	4,0 %	4,5 %	3,5 %	3,9 %
36-60	-	4,1 %	3,5 %	3,9 %
61-90	-	5,4 %	3,2 %	4,1 %
91-180	3,9 %	5,7 %	3,8 %	4,0 %
>180	4,0 %	4,4 %	4,1 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>3,9 %</b>	<b>4,3 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,9 %</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	19 al 23 de Octubre				26 al 30 de Octubre				2 al 6 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	43	1968	2213	8	45	1542	1846	3	17	1302	1381
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1281	726	0	1	1053	489	0	0	963	449
<b>Otros</b>	43	10	562	871	45	7	615	875	17	3	197	632
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>3811</b>	<b>3811</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>3211</b>	<b>3211</b>	<b>20</b>	<b>20</b>	<b>2461</b>	<b>2461</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