

**Fecha de Publicación: 17 de Noviembre de 2009**  
**Fecha de Información: 12 de Noviembre 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\$1148,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,4%.<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         | 143,9               | 377,5        | 325,5                     | 46,5         | 52,0          | 97,4         | 521,4         |
| 15-35        | 241,0               | 374,9        | 280,3                     | 75,8         | 36,6          | 107,2        | 557,9         |
| 36-60        | 4,2                 | 30,4         | 20,0                      | 0,0          | 10,4          | 4,2          | 34,6          |
| 61-90        | 3,9                 | 6,4          | 1,0                       | 0,0          | 5,4           | 3,9          | 10,3          |
| 91-180       | 11,3                | 14,7         | 0,0                       | 0,0          | 9,7           | 6,3          | 21,0          |
| >180         | 3,8                 | 0,0          | 0,0                       | 0,0          | 0,0           | 3,8          | 3,8           |
| <b>Total</b> | <b>408,1</b>        | <b>803,8</b> | <b>626,8</b>              | <b>122,3</b> | <b>114,0</b>  | <b>222,8</b> | <b>1148,9</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 intragrupo |              | Total        |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
|              | Compras/Ventas     | Compras                      | Ventas       |              |
| 3-14         | -                  | 3,3 %                        | 2,9 %        | 3,1 %        |
| 15-35        | 3,3 %              | 3,3 %                        | -0,1 %       | 2,1 %        |
| 36-60        | -                  | 3,4 %                        | 3,1 %        | 3,3 %        |
| 61-90        | -                  | 1,5 %                        | -1,7 %       | 0,3 %        |
| 91-180       | 3,3 %              | 2,6 %                        | -1,4 %       | 1,6 %        |
| >180         | -                  | -                            | 3,8 %        | 3,8 %        |
| <b>Total</b> | <b>3,3 %</b>       | <b>3,3 %</b>                 | <b>1,1 %</b> | <b>2,4 %</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                         | 9 al 13 de Noviembre |           |             |             | 16 al 20 de Noviembre |           |             |             | 23 al 27 de Noviembre |           |             |             |
|----------------------------------|----------------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------|-----------|-------------|-------------|-----------------------|-----------|-------------|-------------|
|                                  | Delivery             |           | NDF         |             | Delivery              |           | NDF         |             | Delivery              |           | NDF         |             |
|                                  | C                    | V         | C           | V           | C                     | V         | C           | V           | C                     | V         | C           | V           |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 20                   | 23        | 1764        | 2264        | 14                    | 33        | 1746        | 1735        | 9                     | 28        | 1384        | 2093        |
| <b>Intragrupa y off-shore***</b> | 0                    | 0         | 1575        | 477         | 0                     | 0         | 1184        | 719         | 0                     | 0         | 1613        | 300         |
| <b>Otros</b>                     | 23                   | 20        | 422         | 1020        | 33                    | 14        | 270         | 746         | 28                    | 9         | 289         | 893         |
| <b>Total</b>                     | <b>43</b>            | <b>43</b> | <b>3760</b> | <b>3760</b> | <b>47</b>             | <b>47</b> | <b>3200</b> | <b>3200</b> | <b>37</b>             | <b>37</b> | <b>3286</b> | <b>3286</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