

**Fecha de Publicación: 19 de Noviembre de 2009**  
**Fecha de Información: 17 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\$808,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,0%.<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	291,9	90,0	22,0	187,0	23,0	59,9	336,9
15-35	199,4	263,4	184,0	21,5	2,4	100,9	385,7
36-60	4,0	2,6	0,0	0,0	2,6	4,0	6,6
61-90	12,1	11,9	3,7	0,0	8,2	12,1	24,0
91-180	26,3	6,2	2,7	0,0	3,5	26,3	32,5
>180	7,0	20,8	0,0	0,0	15,8	2,0	22,8
<b>Total</b>	<b>540,6</b>	<b>394,9</b>	<b>212,4</b>	<b>208,5</b>	<b>55,6</b>	<b>205,1</b>	<b>808,5</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	2,3 %	3,1 %	2,6 %	2,6 %
15-35	2,6 %	3,6 %	3,1 %	3,2 %
36-60	-	3,3 %	3,1 %	3,2 %
61-90	-	3,7 %	3,0 %	3,4 %
91-180	-	3,6 %	3,0 %	3,1 %
>180	4,0 %	3,6 %	2,2 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>2,5 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>2,8 %</b>	<b>3,0 %</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	16 al 20 de Noviembre				23 al 27 de Noviembre				30 de Nov. al 4 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	15	34	1790	1772	11	29	1732	2286	5	32	1321	1686
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1196	729	0	0	1738	524	0	0	1207	490
<b>Otros</b>	34	15	294	780	29	11	312	972	32	5	218	570
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>3280</b>	<b>3280</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>3782</b>	<b>3782</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>2746</b>	<b>2746</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo