

**Fecha de Publicación: 23 de Noviembre de 2009**  
**Fecha de Información: 19 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\$916,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,7%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	208,1	79,4	5,0	72,5	34,4	95,6	247,5
15-35	269,5	453,4	321,0	60,0	22,9	100,0	613,4
36-60	1,1	1,3	0,0	0,0	1,3	1,1	2,3
61-90	35,8	3,3	0,0	0,0	3,3	35,8	39,0
91-180	0,3	10,5	5,0	0,0	5,5	0,3	10,7
>180	2,6	1,0	0,0	0,0	1,0	2,6	3,6
<b>Total</b>	<b>517,2</b>	<b>548,7</b>	<b>331,0</b>	<b>132,5</b>	<b>68,2</b>	<b>235,2</b>	<b>916,5</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	3,7 %	3,2 %	0,2 %	1,2 %
15-35	3,3 %	3,4 %	3,4 %	3,4 %
36-60	-	3,8 %	3,1 %	3,5 %
61-90	-	3,5 %	3,2 %	3,2 %
91-180	-	3,6 %	3,2 %	3,5 %
>180	-	4,0 %	3,3 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>1,9 %</b>	<b>2,7 %</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>	18	34	1849	1792	14	32	1990	2760	5	33	1537	1857
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	1216	789	0	0	2113	619	0	0	1247	573
<b>Otros</b>	34	18	294	778	32	14	381	1106	33	5	249	603
<b>Total</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>3360</b>	<b>3360</b>	<b>46</b>	<b>46</b>	<b>4484</b>	<b>4484</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>3034</b>	<b>3034</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo