

**Fecha de Publicación: 25 de Noviembre de 2009**  
**Fecha de Información: 23 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\$794,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	183,5	58,0	38,0	135,0	13,0	41,5	234,4
15-35	151,8	298,1	185,5	24,0	29,6	44,8	366,8
36-60	26,9	117,2	93,0	0,0	10,9	13,6	130,9
61-90	22,5	0,6	0,0	0,0	0,6	22,5	23,1
91-180	35,8	1,5	0,0	0,0	1,5	35,8	37,3
>180	1,7	0,8	0,0	0,0	0,1	1,0	1,7
<b>Total</b>	<b>422,2</b>	<b>476,1</b>	<b>316,5</b>	<b>159,0</b>	<b>55,6</b>	<b>159,2</b>	<b>794,2</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	0,0 %	2,8 %	2,9 %	2,8 %
15-35	2,7 %	3,5 %	3,2 %	3,2 %
36-60	3,4 %	3,7 %	3,2 %	3,6 %
61-90	-	3,9 %	3,2 %	3,2 %
91-180	-	4,1 %	3,2 %	3,3 %
>180	4,0 %	5,9 %	3,4 %	3,7 %
<b>Total</b>	<b>2,6 %</b>	<b>3,5 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,2 %</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	23 al 27 de Noviembre				30 de Nov. al 4 de Diciembre				7 al 11 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	38	2162	2781	7	27	1678	1929	8	16	930	1165
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	2117	740	0	2	1296	641	0	0	765	270
<b>Otros</b>	38	12	398	1156	27	6	265	669	16	8	241	501
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>4676</b>	<b>4676</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>3239</b>	<b>3239</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>1936</b>	<b>1936</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