

**Fecha de Publicación: 26 de Noviembre de 2009**  
**Fecha de Información: 24 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\$855,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,9%.<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	204,2	95,9	55,5	163,5	40,4	40,7	300,0
15-35	112,2	315,2	291,5	3,0	18,7	104,2	422,4
36-60	19,5	83,4	81,0	0,0	2,4	19,5	102,8
61-90	16,2	8,3	6,0	0,0	2,4	16,2	24,5
91-180	4,5	0,9	0,0	0,0	0,9	4,5	5,4
>180	0,0	0,4	0,0	0,0	0,4	0,0	0,4
<b>Total</b>	<b>356,5</b>	<b>504,0</b>	<b>434,0</b>	<b>166,5</b>	<b>65,0</b>	<b>185,0</b>	<b>855,4</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	-	3,0 %	1,9 %	2,3 %
15-35	3,2 %	3,5 %	2,8 %	3,3 %
36-60	-	3,4 %	2,9 %	3,2 %
61-90	-	2,9 %	3,0 %	3,0 %
91-180	-	3,2 %	3,1 %	3,1 %
>180	-	4,3 %	-	4,3 %
<b>Total</b>	<b>3,2 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>2,4 %</b>	<b>2,9 %</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	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
Sector Financiero**	12	38	2256	2810	8	27	1787	1995	8	16	946	1185
Intragrupa y off-shore***	0	0	2142	816	0	2	1326	729	0	0	773	270
Otros	38	12	402	1175	27	6	301	691	16	8	253	517
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>4800</b>	<b>4800</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>3414</b>	<b>3414</b>	<b>24</b>	<b>24</b>	<b>1973</b>	<b>1973</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