

Fecha de Publicación: 2 de Diciembre de 2009  
 Fecha de Información: 30 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\$845,9 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	142,7	152,8	85,0	105,0	67,8	37,7	295,5
15-35	93,3	206,4	167,3	25,5	14,6	43,3	275,2
36-60	115,2	55,3	47,5	0,0	7,8	115,2	170,5
61-90	13,3	70,1	69,0	0,0	1,1	13,3	83,4
91-180	11,3	3,3	0,0	0,0	3,3	11,3	14,6
>180	6,6	0,1	0,0	5,0	0,1	1,6	6,7
<b>Total</b>	<b>382,5</b>	<b>487,9</b>	<b>368,8</b>	<b>135,5</b>	<b>94,6</b>	<b>222,5</b>	<b>845,9</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	-	2,8 %	3,9 %	3,3 %
15-35	2,0 %	3,6 %	3,0 %	3,2 %
36-60	-	3,2 %	2,8 %	2,9 %
61-90	-	3,7 %	2,9 %	3,6 %
91-180	-	3,7 %	2,9 %	3,1 %
>180	-	5,7 %	3,5 %	3,5 %
<b>Total</b>	<b>2,0 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,3 %</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**

Sectores	30 de Nov. al 4 de Diciembre				7 al 11 de Diciembre				14 al 18 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	26	2046	2126	10	16	1072	1469	16	32	1219	1629
Intragrupa y off-shore***	0	2	1368	871	0	0	968	312	0	0	1142	210
Otros	26	11	391	808	16	10	343	602	32	16	233	754
<b>Total</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>3804</b>	<b>3804</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>2383</b>	<b>2383</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2593</b>	<b>2593</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