

Fecha de Publicación: 3 de Diciembre de 2009  
 Fecha de Información: 01 de Diciembre 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\$701,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.<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	156,3	55,2	15,1	89,4	25,1	52,0	196,5
15-35	160,7	191,4	157,8	114,3	0,6	13,5	319,1
36-60	72,9	12,3	10,0	0,0	2,3	72,9	85,2
61-90	37,8	22,3	20,0	0,0	2,3	37,8	60,1
91-180	35,6	2,4	0,0	0,0	2,4	35,6	38,1
>180	1,5	1,2	0,0	0,0	1,2	1,5	2,7
<b>Total</b>	<b>464,9</b>	<b>284,9</b>	<b>202,9</b>	<b>203,6</b>	<b>34,0</b>	<b>213,3</b>	<b>701,8</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	3,6 %	3,4 %	2,9 %	3,1 %
15-35	2,9 %	3,7 %	3,0 %	3,3 %
36-60	-	3,5 %	3,0 %	3,0 %
61-90	-	3,0 %	3,0 %	3,0 %
91-180	-	4,2 %	2,9 %	3,0 %
>180	-	5,1 %	3,3 %	4,1 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>3,0 %</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	25	2109	2139	12	17	1130	1496	16	32	1285	1659
Intragruppo y off-shore***	0	2	1370	922	0	1	981	342	0	0	1156	243
Otros	25	11	401	819	17	11	356	629	32	16	233	772
<b>Total</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>3880</b>	<b>3880</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>2467</b>	<b>2467</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2674</b>	<b>2674</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