

**Fecha de Publicación: 07 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 03 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\$1159,7 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         | 286,1               | 110,0        | 82,9                      | 232,2        | 27,1          | 53,9         | 396,1         |
| 15-35        | 140,7               | 316,3        | 239,5                     | 39,6         | 22,8          | 47,1         | 402,9         |
| 36-60        | 93,5                | 105,6        | 95,0                      | 20,0         | 0,6           | 63,5         | 189,0         |
| 61-90        | 22,2                | 0,4          | 0,0                       | 0,0          | 0,4           | 22,2         | 22,6          |
| 91-180       | 25,8                | 113,3        | 102,5                     | 0,0          | 10,8          | 25,8         | 139,1         |
| >180         | 0,0                 | 10,0         | 0,0                       | 0,0          | 10,0          | 0,0          | 10,0          |
| <b>Total</b> | <b>568,3</b>        | <b>655,4</b> | <b>519,9</b>              | <b>291,8</b> | <b>71,5</b>   | <b>212,5</b> | <b>1159,7</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         | -                  | 2,0 %                        | 2,9 %        | 2,7 %        |
| 15-35        | 2,0 %              | 3,1 %                        | 3,0 %        | 2,9 %        |
| 36-60        | 3,2 %              | 3,2 %                        | 2,8 %        | 3,0 %        |
| 61-90        | -                  | 3,8 %                        | 3,0 %        | 3,0 %        |
| 91-180       | -                  | 3,3 %                        | 2,9 %        | 3,2 %        |
| >180         | -                  | 3,4 %                        | -            | 3,4 %        |
| <b>Total</b> | <b>2,2 %</b>       | <b>3,0 %</b>                 | <b>2,9 %</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**

| Sectores                         | 30 de Nov. al 4 de Diciembre |           |             |             |           |           |             |             |           |           |             |             | 7 al 11 de Diciembre |   |     |   |          |   | 14 al 18 de Diciembre |  |  |  |  |  |
|----------------------------------|------------------------------|-----------|-------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|-----------|-----------|-------------|-------------|----------------------|---|-----|---|----------|---|-----------------------|--|--|--|--|--|
|                                  | Delivery                     |           |             |             | NDF       |           |             |             | Delivery  |           | NDF         |             | Delivery             |   | NDF |   | Delivery |   | NDF                   |  |  |  |  |  |
|                                  | C                            | V         | C           | V           | C         | V         | C           | V           | C         | V         | C           | V           | C                    | V | C   | V | C        | V |                       |  |  |  |  |  |
| <b>Sector Financiero**</b>       | 13                           | 26        | 2216        | 2139        | 14        | 17        | 1198        | 1508        | 20        | 33        | 1531        | 1816        |                      |   |     |   |          |   |                       |  |  |  |  |  |
| <b>Intragrupa y off-shore***</b> | 0                            | 2         | 1370        | 1029        | 0         | 1         | 981         | 374         | 0         | 0         | 1244        | 405         |                      |   |     |   |          |   |                       |  |  |  |  |  |
| <b>Otros</b>                     | 26                           | 11        | 401         | 819         | 17        | 13        | 369         | 666         | 33        | 20        | 283         | 836         |                      |   |     |   |          |   |                       |  |  |  |  |  |
| <b>Total</b>                     | <b>39</b>                    | <b>39</b> | <b>3987</b> | <b>3987</b> | <b>31</b> | <b>31</b> | <b>2548</b> | <b>2548</b> | <b>53</b> | <b>53</b> | <b>3058</b> | <b>3058</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