

**Fecha de Publicación: 09 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 04 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\$834,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 2,8%.<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	137,2	139,4	79,8	61,8	44,6	60,4	261,6
15-35	92,5	222,6	189,2	28,0	20,4	51,5	302,0
36-60	84,0	45,5	6,5	0,0	39,0	84,0	129,6
61-90	14,3	0,1	0,0	0,0	0,1	14,3	14,3
91-180	111,6	18,4	0,0	0,0	3,4	96,6	115,0
>180	9,2	5,8	0,0	0,0	2,8	6,2	12,0
<b>Total</b>	<b>448,8</b>	<b>431,7</b>	<b>275,5</b>	<b>89,8</b>	<b>110,2</b>	<b>313,0</b>	<b>834,5</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	3,5 %	2,5 %	2,7 %	2,7 %
15-35	2,8 %	3,4 %	2,9 %	3,2 %
36-60	-	2,6 %	2,3 %	2,4 %
61-90	-	3,4 %	2,9 %	2,9 %
91-180	3,3 %	3,3 %	2,6 %	2,7 %
>180	0,0 %	3,7 %	3,2 %	2,5 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>3,1 %</b>	<b>2,6 %</b>	<b>2,8 %</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	C	V										
Sector Financiero**	13	29	2216	2141	16	17	1256	1564	10	3	532	513												
Intragrupa y off-shore***	0	2	1370	1029	0	1	1018	411	0	0	317	213												
Otros	29	11	403	819	17	15	387	687	3	10	56	179												
<b>Total</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>3989</b>	<b>3989</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>2662</b>	<b>2662</b>	<b>13</b>	<b>13</b>	<b>905</b>	<b>905</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