

**Fecha de Publicación: 16 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 14 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\$760,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,3%.<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	255,3	33,0	10,0	202,9	18,0	47,4	283,3
15-35	187,2	130,3	73,5	85,0	47,8	93,2	308,5
36-60	45,8	42,8	20,0	0,0	22,8	45,8	88,6
61-90	7,8	31,4	20,0	0,0	6,4	2,8	34,2
91-180	37,5	8,1	5,0	0,0	3,1	37,5	45,6
>180	0,2	0,1	0,0	0,0	0,1	0,2	0,3
<b>Total</b>	<b>533,8</b>	<b>245,8</b>	<b>128,5</b>	<b>287,9</b>	<b>98,3</b>	<b>226,9</b>	<b>760,5</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	1,8 %	0,8 %	0,9 %	0,9 %
15-35	1,7 %	1,6 %	1,0 %	1,3 %
36-60	-	3,4 %	1,5 %	2,1 %
61-90	1,5 %	1,7 %	1,5 %	1,6 %
91-180	-	3,0 %	1,8 %	2,0 %
>180	-	3,6 %	2,9 %	3,2 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>1,7 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>1,3 %</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	14 al 18 de Diciembre				21 al 25 de Diciembre				28 de Dic. al 1 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	51	41	2235	2126	3	20	734	1032	7	25	886	1031
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	3	24	1352	824	0	0	738	225	0	0	669	439
<b>Otros</b>	38	27	415	1052	20	3	116	331	25	7	114	199
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4002</b>	<b>4002</b>	<b>23</b>	<b>23</b>	<b>1588</b>	<b>1588</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>1669</b>	<b>1669</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