

**Fecha de Publicación: 17 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 15 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\$665,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	64,9	80,5	72,7	25,5	7,8	39,4	145,4
15-35	226,6	123,9	19,1	63,0	20,8	79,6	266,4
36-60	23,3	67,7	0,0	0,0	67,7	23,3	91,0
61-90	39,7	36,1	7,0	0,0	2,1	12,7	48,8
91-180	81,8	32,3	0,0	0,0	22,3	71,8	104,0
>180	9,3	5,6	0,0	0,0	0,6	4,3	10,0
<b>Total</b>	<b>445,6</b>	<b>346,1</b>	<b>98,8</b>	<b>88,5</b>	<b>121,3</b>	<b>231,1</b>	<b>665,7</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	-	0,3 %	0,1 %	0,2 %
15-35	0,5 %	1,4 %	0,7 %	0,7 %
36-60	-	0,8 %	1,4 %	0,9 %
61-90	2,1 %	2,4 %	1,4 %	2,0 %
91-180	0,0 %	2,5 %	1,2 %	1,4 %
>180	2,5 %	3,3 %	2,5 %	2,6 %
<b>Total</b>	<b>0,9 %</b>	<b>1,2 %</b>	<b>0,8 %</b>	<b>0,9 %</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	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	2280	2206	3	21	757	1039	8	25	922	1043
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	24	1412	825	0	0	739	235	0	0	681	453
<b>Otros</b>	38	27	415	1056	21	3	123	344	25	8	114	221
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4107</b>	<b>4087</b>	<b>24</b>	<b>24</b>	<b>1619</b>	<b>1619</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>1718</b>	<b>1718</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