

**Fecha de Publicación: 18 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 16 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\$680,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.<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	189,2	91,0	73,1	132,5	11,9	50,7	274,2
15-35	100,6	216,8	160,0	31,5	39,8	52,1	300,4
36-60	6,6	33,7	14,0	0,0	19,7	6,6	40,3
61-90	6,8	18,9	0,0	0,0	18,9	6,8	25,7
91-180	36,9	1,9	0,0	0,0	1,9	36,9	38,8
>180	0,6	0,9	0,0	0,0	0,9	0,6	1,4
<b>Total</b>	<b>340,7</b>	<b>363,1</b>	<b>247,1</b>	<b>164,0</b>	<b>93,0</b>	<b>153,7</b>	<b>680,8</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	0,8 %	0,1 %	0,0 %	0,0 %
15-35	0,2 %	0,4 %	-0,7 %	0,1 %
36-60	-	0,5 %	0,8 %	0,5 %
61-90	-	1,8 %	0,5 %	1,4 %
91-180	-	2,8 %	1,3 %	1,3 %
>180	-	3,9 %	1,5 %	2,9 %
<b>Total</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,3 %</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**

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	2307	2259	3	23	841	1056	8	26	1002	1066
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	24	1463	852	0	0	739	277	0	0	703	517
<b>Otros</b>	38	27	417	1056	23	3	133	379	26	8	114	237
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4187</b>	<b>4167</b>	<b>26</b>	<b>26</b>	<b>1712</b>	<b>1712</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>1819</b>	<b>1819</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