

**Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 18 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\$633,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.<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	65,0	33,7	15,0	32,0	18,6	32,9	98,6
15-35	208,4	169,9	62,6	104,6	35,1	31,6	306,1
36-60	79,0	58,5	0,0	0,0	2,8	23,4	81,9
61-90	15,2	47,7	45,0	0,0	2,2	14,7	62,4
91-180	33,3	12,3	0,0	3,0	11,1	29,0	44,4
>180	22,7	24,2	17,0	0,0	0,2	15,7	39,9
<b>Total</b>	<b>423,5</b>	<b>346,3</b>	<b>139,6</b>	<b>139,6</b>	<b>70,1</b>	<b>147,2</b>	<b>633,2</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-2,0 %	0,3 %	-0,2 %	0,0 %
15-35	0,0 %	0,4 %	0,0 %	0,2 %
36-60	0,8 %	2,7 %	0,3 %	0,7 %
61-90	0,5 %	1,9 %	1,0 %	1,7 %
91-180	1,6 %	2,5 %	1,4 %	1,7 %
>180	1,1 %	3,0 %	2,1 %	2,3 %
<b>Total</b>	<b>0,4 %</b>	<b>1,1 %</b>	<b>0,3 %</b>	<b>0,6 %</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	2327	2259	7	24	957	1097	10	26	1126	1139
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	3	24	1463	872	0	0	741	351	0	0	726	573
<b>Otros</b>	38	27	417	1056	24	7	172	422	26	10	121	260
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4207</b>	<b>4187</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>1870</b>	<b>1870</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>1973</b>	<b>1973</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 intragruppo