

**Fecha de Publicación: 24 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 22 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\$303,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,2%.<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	32,2	22,8	8,2	17,7	14,6	14,5	55,0
15-35	73,2	87,9	65,0	30,0	10,9	31,2	149,1
36-60	20,0	5,9	0,0	0,0	5,9	20,0	25,9
61-90	39,5	2,4	1,0	0,0	1,4	39,5	41,8
91-180	13,7	3,0	0,0	0,0	3,0	13,7	16,7
>180	7,7	6,7	0,0	0,0	6,7	7,7	14,5
<b>Total</b>	<b>186,3</b>	<b>128,8</b>	<b>74,2</b>	<b>47,7</b>	<b>42,6</b>	<b>126,6</b>	<b>303,1</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	-	0,1 %	-0,3 %	-0,1 %
15-35	0,0 %	0,2 %	-0,6 %	-0,2 %
36-60	-	0,9 %	-0,2 %	0,1 %
61-90	-	2,2 %	0,4 %	0,5 %
91-180	-	2,6 %	1,2 %	1,5 %
>180	-	3,3 %	2,1 %	2,7 %
<b>Total</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,5 %</b>	<b>0,0 %</b>	<b>0,2 %</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	21 al 25 de Diciembre				28 de Dic. al 1 de Enero				4 al 8 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	7	25	1019	1103	5	25	1172	1216	5	13	935	1489
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	741	408	0	0	769	581	0	0	1091	127
<b>Otros</b>	24	7	178	427	25	5	135	279	13	5	146	555
<b>Total</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>1937</b>	<b>1937</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2076</b>	<b>2076</b>	<b>17</b>	<b>17</b>	<b>2172</b>	<b>2172</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