

**Fecha de Publicación: 29 de Diciembre de 2009**  
**Fecha de Información: 24 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\$63,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -0,3%.<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	2,0	2,0	1,6	0,0	0,4	2,0	4,0
15-35	30,5	25,1	23,0	23,6	2,1	6,9	55,6
36-60	0,3	0,0	0,0	0,0	0,0	0,3	0,3
61-90	2,5	0,3	0,0	0,0	0,3	2,5	2,7
91-180	0,3	0,5	0,0	0,0	0,5	0,3	0,8
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0	0,0
<b>Total</b>	<b>35,6</b>	<b>27,8</b>	<b>24,6</b>	<b>23,6</b>	<b>3,2</b>	<b>12,0</b>	<b>63,4</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	-	0,5 %	-1,4 %	-0,5 %
15-35	-	0,1 %	-0,8 %	-0,4 %
36-60	-	-	-0,5 %	-0,5 %
61-90	-	4,7 %	0,9 %	1,3 %
91-180	-	2,8 %	-1,2 %	1,4 %
>180	-	-	-	-
<b>Total</b>	-	0,2 %	-0,7 %	-0,3 %

\*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	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
Sector Financiero**	6	27	1019	1102	7	25	1175	1230	5	13	948	1537
Intragrupa y off-shore***	0	0	741	408	0	0	771	581	0	0	1140	132
Otros	27	6	177	427	25	7	148	282	13	5	144	563
<b>Total</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>1936</b>	<b>1936</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2094</b>	<b>2094</b>	<b>18</b>	<b>18</b>	<b>2232</b>	<b>2232</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