

**Fecha de Publicación: 2 de Enero de 2009**  
**Fecha de Información: 29 de Diciembre de 2008 <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\$479,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,8%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	124,5	15,8	15,8	84,5	-	40,0	140,3
15-35	157,2	92,6	69,6	129,2	5,0	10,0	231,8
36-60	14,7	71,6	65,6	8,7	-	-	80,3
61-90	1,3	0,8	0,8	1,3	-	-	2,1
91-180	3,6	2,5	2,0	3,1	-	-	5,5
>180	4,6	14,5	14,5	4,6	-	-	19,1
<b>Total</b>	<b>305,9</b>	<b>197,8</b>	<b>168,3</b>	<b>231,3</b>	<b>5,0</b>	<b>50,0</b>	<b>479,1</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

**Cuadro No. 2**

**Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada**

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	9,4 %	-0,1 %	1,4 %
15-35	11,1 %	5,4 %	2,0 %	3,8 %
36-60	1,0 %	5,8 %	7,1 %	5,6 %
61-90	-	7,5 %	6,6 %	7,0 %
91-180	7,0 %	6,8 %	6,4 %	6,6 %
>180	-	7,1 %	6,4 %	6,9 %
<b>Total</b>	<b>8,5 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>1,6 %</b>	<b>3,8 %</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	29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero				12 al 16 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	4	25	495	652	3	24	880	1057	28	21	945	833
<b>Otros***</b>	25	4	500	374	24	3	829	683	21	28	585	744
<b>Intragrupo</b>	0	0	98	66	0	0	113	83	0	0	107	60
<b>Total</b>	29	29	1092	1092	27	27	1822	1822	50	50	1637	1637

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Otros agentes sin intragrupo

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo