

**Fecha de Publicación: 26 de Febrero de 2009**  
**Fecha de Información: 24 de Febrero 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\$527,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<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	154,9	123,1	11,0	31,0	82,1	93,9	248,0
15-35	149,3	90,5	41,7	45,0	17,7	73,3	208,7
36-60	6,0	7,4	0,0	5,0	7,3	0,9	13,3
61-90	1,8	1,2	0,0	0,0	1,2	1,8	3,0
91-180	2,9	16,2	0,0	0,0	16,2	2,9	19,1
>180	10,2	29,0	15,0	0,0	10,0	6,2	35,2
<b>Total</b>	<b>325,1</b>	<b>267,3</b>	<b>67,7</b>	<b>81,0</b>	<b>134,5</b>	<b>179,0</b>	<b>527,3</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	10,2 %	-0,3 %	5,0 %	3,6 %
15-35	9,7 %	10,1 %	5,3 %	6,9 %
36-60	9,4 %	9,5 %	5,3 %	7,6 %
61-90	-	8,5 %	7,3 %	7,8 %
91-180	-	5,8 %	6,5 %	5,9 %
>180	5,1 %	5,8 %	6,1 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>9,7 %</b>	<b>3,6 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,3 %</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**

Sector	23 al 27 de Febrero				2 al 6 de Marzo				9 al 13 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	39	1695	2051	8	14	1084	1336	9	12	640	1053
Intragrupa y off-shore***	0	0	1191	531	0	0	831	262	0	0	732	107
Otros	39	13	522	826	14	8	320	637	12	9	197	409
<b>Total</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>3408</b>	<b>3408</b>	<b>22</b>	<b>22</b>	<b>2235</b>	<b>2235</b>	<b>22</b>	<b>22</b>	<b>1569</b>	<b>1569</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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo