

**Fecha de Publicación: 20 de Marzo de 2009**  
**Fecha de Información: 18 de Marzo 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\$742,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.<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	201,8	134,2	22,7	77,2	101,5	114,6	326,0
15-35	136,5	246,9	196,0	30,0	6,8	62,4	339,3
36-60	2,8	5,9	2,4	0,0	3,5	2,7	8,6
61-90	44,0	5,5	1,0	40,0	4,3	3,9	49,4
91-180	0,3	12,0	0,0	0,0	12,0	0,3	12,3
>180	0,3	6,3	0,0	0,0	6,3	0,3	6,6
<b>Total</b>	<b>385,6</b>	<b>410,8</b>	<b>222,1</b>	<b>147,2</b>	<b>134,4</b>	<b>184,2</b>	<b>742,2</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	0,0 %	5,1 %	5,2 %	5,0 %
15-35	6,9 %	6,8 %	4,1 %	6,1 %
36-60	6,6 %	5,4 %	3,8 %	4,7 %
61-90	6,1 %	6,1 %	5,4 %	5,5 %
91-180	-	5,5 %	4,3 %	5,5 %
>180	-	5,5 %	4,5 %	5,4 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,5 %</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	16 al 20 de Marzo				23 al 27 de Marzo				30 de Mar. al 3 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	71	1642	2287	8	24	1038	1049	7	24	1045	1331
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	4	1	1458	491	0	0	482	348	0	0	812	341
<b>Otros</b>	66	10	568	890	24	8	473	596	24	7	340	524
<b>Total</b>	<b>81</b>	<b>81</b>	<b>3668</b>	<b>3668</b>	<b>32</b>	<b>32</b>	<b>1993</b>	<b>1993</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>2197</b>	<b>2197</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 intragruppo