

**Fecha de Publicación: 22 de Abril de 2009**  
**Fecha de Información: 20 de Abril 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\$334,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.<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	87,9	38,9	0,8	42,0	4,7	12,6	93,5
15-35	93,6	137,1	75,5	22,2	53,6	63,4	222,7
36-60	6,8	1,4	0,0	0,0	1,4	6,8	8,2
61-90	0,8	1,1	0,0	0,0	0,2	0,0	1,1
91-180	0,2	4,8	0,0	0,0	4,8	0,2	5,0
>180	1,4	3,1	0,0	0,0	2,3	0,5	3,6
<b>Total</b>	<b>190,7</b>	<b>186,4</b>	<b>76,3</b>	<b>64,2</b>	<b>67,1</b>	<b>83,5</b>	<b>334,1</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,5 %	7,5 %	6,6 %	5,8 %
15-35	6,6 %	6,7 %	6,1 %	6,4 %
36-60	-	6,4 %	5,5 %	5,7 %
61-90	6,2 %	5,8 %	-	6,1 %
91-180	-	6,0 %	4,4 %	6,0 %
>180	5,3 %	5,7 %	4,3 %	5,4 %
<b>Total</b>	<b>5,0 %</b>	<b>6,6 %</b>	<b>6,2 %</b>	<b>6,2 %</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**

Sectores	20 al 24 de Abril				27 de Abr. al 1 de Mayo				4 al 8 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	26	1630	1848	8	41	1157	1413	6	36	716	784
Intragruppo y off-shore***	1	1	983	544	0	0	858	528	0	0	533	212
Otros	25	8	524	744	41	8	361	436	36	6	166	420
<b>Total</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>3137</b>	<b>3137</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>2377</b>	<b>2377</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>1416</b>	<b>1416</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