

**Fecha de Publicación: 27 de Febrero de 2009**  
**Fecha de Información: 25 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\$602,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,7%.<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	83,0	95,1	50,0	4,9	17,1	50,1	150,2
15-35	56,8	244,1	122,8	1,5	105,3	39,3	284,9
36-60	58,0	38,0	32,0	20,5	3,0	34,5	93,0
61-90	13,6	3,7	0,0	0,0	3,7	13,6	17,3
91-180	46,3	7,3	0,0	0,0	7,3	46,3	53,5
>180	2,5	1,2	0,0	0,0	1,2	2,5	3,7
<b>Total</b>	<b>260,2</b>	<b>389,4</b>	<b>204,8</b>	<b>26,9</b>	<b>137,6</b>	<b>186,3</b>	<b>602,6</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	16,6 %	13,8 %	11,2 %	13,2 %
15-35	11,1 %	9,2 %	10,1 %	9,4 %
36-60	10,3 %	9,3 %	8,2 %	8,6 %
61-90	-	7,2 %	7,6 %	7,5 %
91-180	-	7,7 %	6,0 %	6,2 %
>180	-	6,8 %	6,7 %	6,7 %
<b>Total</b>	<b>14,3 %</b>	<b>9,6 %</b>	<b>8,8 %</b>	<b>9,7 %</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	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	41	1696	2052	10	14	1125	1416	10	12	688	1071
Intragruppo y off-shore***	0	0	1191	531	0	0	879	264	0	0	733	110
Otros	41	13	522	827	14	10	334	658	12	10	203	444
<b>Total</b>	<b>54</b>	<b>54</b>	<b>3410</b>	<b>3410</b>	<b>24</b>	<b>24</b>	<b>2338</b>	<b>2338</b>	<b>22</b>	<b>22</b>	<b>1625</b>	<b>1625</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