

**Fecha de Publicación: 06 de Marzo de 2009**  
**Fecha de Información: 02 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\$759,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,5%.<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	225,6	143,5	20,0	105,9	59,4	55,7	305,0
15-35	121,9	296,6	225,7	5,0	43,9	89,9	391,5
36-60	6,0	3,6	0,0	0,0	1,5	3,9	7,5
61-90	2,5	0,5	0,0	0,0	0,5	2,5	3,0
91-180	2,1	21,2	15,0	0,0	6,2	2,1	23,3
>180	28,1	13,9	0,0	0,0	0,9	15,1	29,0
<b>Total</b>	<b>386,1</b>	<b>479,3</b>	<b>260,7</b>	<b>110,9</b>	<b>112,5</b>	<b>169,2</b>	<b>759,4</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	3,4 %	7,0 %	6,3 %	5,8 %
15-35	4,8 %	8,1 %	5,8 %	7,2 %
36-60	7,9 %	8,3 %	7,3 %	7,7 %
61-90	-	8,1 %	7,2 %	7,4 %
91-180	-	6,7 %	5,8 %	6,6 %
>180	5,4 %	6,1 %	5,4 %	5,4 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>7,7 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>6,5 %</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	2 al 6 de Marzo				9 al 13 de Marzo				16 al 20 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	13	16	1403	1633	10	20	794	1194	6	32	864	1600
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	942	380	0	0	760	144	0	0	1103	181
<b>Otros</b>	16	13	445	778	20	10	269	486	32	6	262	448
<b>Total</b>	<b>28</b>	<b>28</b>	<b>2790</b>	<b>2790</b>	<b>31</b>	<b>31</b>	<b>1824</b>	<b>1824</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>2229</b>	<b>2229</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