

**Fecha de Publicación: 3 de Abril de 2009**  
**Fecha de Información: 01 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\$793,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.<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	160,3	147,0	47,0	32,0	56,8	85,1	264,1
15-35	243,5	259,7	166,6	178,5	63,1	35,0	473,2
36-60	13,5	16,0	10,0	10,0	3,0	0,5	26,6
61-90	13,3	12,1	0,0	0,0	2,3	3,5	15,6
91-180	8,7	0,2	0,0	0,0	0,2	8,7	8,9
>180	2,7	2,3	0,0	0,0	2,3	2,7	5,0
<b>Total</b>	<b>442,0</b>	<b>437,3</b>	<b>223,6</b>	<b>220,5</b>	<b>127,8</b>	<b>135,5</b>	<b>793,3</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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	6,1 %	5,0 %	5,1 %	5,2 %
15-35	11,2 %	4,3 %	2,8 %	4,0 %
36-60	6,0 %	6,3 %	6,3 %	6,3 %
61-90	3,9 %	5,9 %	4,8 %	4,4 %
91-180	-	5,9 %	4,8 %	4,8 %
>180	-	5,2 %	4,6 %	4,9 %
<b>Total</b>	<b>7,6 %</b>	<b>4,6 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>4,6 %</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	30 de Mar. al 3 de Abril				6 al 10 de Abril				13 al 17 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	29	26	1744	1778	11	23	1178	1245	20	50	1290	1417
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	969	581	0	0	749	525	0	0	845	385
<b>Otros</b>	25	29	589	943	23	11	234	391	50	20	362	695
<b>Total</b>	<b>55</b>	<b>55</b>	<b>3302</b>	<b>3302</b>	<b>34</b>	<b>34</b>	<b>2160</b>	<b>2160</b>	<b>70</b>	<b>70</b>	<b>2496</b>	<b>2496</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo