

**Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2009**  
**Fecha de Información: 16 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\$907,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,9	230,3	138,0	15,6	92,0	59,0	304,9
15-35	222,4	289,5	225,3	7,0	55,2	206,4	503,0
36-60	11,0	5,6	0,0	8,0	5,6	3,0	16,6
61-90	15,0	6,4	1,0	0,0	5,4	15,0	21,4
91-180	0,2	16,0	0,0	0,0	16,0	0,2	16,2
>180	0,0	45,0	30,0	0,0	15,0	0,0	45,0
<b>Total</b>	<b>323,6</b>	<b>592,7</b>	<b>394,3</b>	<b>30,6</b>	<b>189,1</b>	<b>283,7</b>	<b>907,0</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	5,6 %	3,8 %	3,3 %	3,6 %
15-35	6,1 %	6,7 %	5,8 %	6,3 %
36-60	-	6,4 %	5,3 %	5,7 %
61-90	-	6,0 %	5,9 %	5,9 %
91-180	-	5,1 %	4,9 %	5,1 %
>180	-	5,2 %	4,4 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>5,6 %</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**

Sectores	13 al 17 de Abril				20 al 24 de Abril				27 de Abr. al 1 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	38	171	1795	1884	8	28	1510	1638	8	32	1013	1356
<b>Intragrupa y off-shore***</b>	0	0	1153	514	0	1	859	522	0	0	841	455
<b>Otros</b>	171	38	500	1050	28	7	476	686	32	8	354	399
<b>Total</b>	<b>209</b>	<b>209</b>	<b>3448</b>	<b>3448</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>2846</b>	<b>2846</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>2209</b>	<b>2209</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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo