

**Fecha de Publicación: 12 de Mayo de 2009**  
**Fecha de Información: 08 de Mayo 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\$408,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.<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	116,3	35,9	17,5	78,0	8,3	28,2	142,1
15-35	108,3	132,3	72,3	38,0	44,0	54,3	224,6
36-60	3,4	3,9	0,1	0,0	3,8	3,4	7,3
61-90	4,6	4,9	0,0	0,0	4,9	4,6	9,6
91-180	0,3	2,2	0,0	0,0	2,2	0,3	2,5
>180	0,5	22,1	20,0	0,0	1,6	0,0	22,1
<b>Total</b>	<b>233,4</b>	<b>201,4</b>	<b>109,9</b>	<b>116,0</b>	<b>64,9</b>	<b>90,8</b>	<b>408,2</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	5,7 %	6,4 %	5,7 %	5,9 %
15-35	5,0 %	6,1 %	5,3 %	5,7 %
36-60	-	5,8 %	5,1 %	5,5 %
61-90	-	5,4 %	4,8 %	5,1 %
91-180	-	5,2 %	2,3 %	4,9 %
>180	4,6 %	4,5 %	-	4,5 %
<b>Total</b>	<b>5,3 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>5,5 %</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**

Sector	4 al 8 de Mayo						11 al 15 de Mayo				18 al 22 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V		
<b>Sector Financiero**</b>	6	43	1195	1416	18	26	1564	1796	5	32	1135	1544		
<b>Intragruppo y off-shore***</b>	0	0	866	402	0	0	1271	748	0	0	992	409		
<b>Otros</b>	43	6	432	675	26	18	358	649	32	5	322	496		
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>2492</b>	<b>2492</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>3194</b>	<b>3194</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>2449</b>	<b>2449</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