

**Fecha de Publicación: 15 de Septiembre de 2008**  
**Fecha de Información: 11 de Septiembre de 2008 <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\$973,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.<sup>2</sup>

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

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	115,7	231,1	71,1	115,6	160,0	-	346,8
15-35	132,2	349,2	235,4	114,2	105,8	10,0	473,4
36-60	9,3	5,2	5,2	9,3	-	-	14,5
61-90	18,3	4,1	4,1	18,3	-	-	22,4
91-180	20,7	66,7	66,7	20,7	-	-	87,4
>180	28,9	0,1	0,1	28,9	-	-	29,0
<b>Total</b>	<b>325,1</b>	<b>656,4</b>	<b>382,5</b>	<b>307,1</b>	<b>265,8</b>	<b>10,0</b>	<b>973,5</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales)

**Cuadro No. 2**

**Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada**

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-12,2 %	-1,7 %	6,5 %	3,4 %
15-35	5,0 %	6,8 %	0,9 %	4,9 %
36-60	-	7,8 %	6,3 %	6,8 %
61-90	-	9,9 %	6,2 %	6,9 %
91-180	-	5,9 %	5,9 %	5,9 %
>180	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,1 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>4,8 %</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	8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	89	24	1742	2284	78	33	1696	1940	51	35	1533	1588
<b>Otros***</b>	23	89	1359	1478	33	78	1255	1285	35	51	1165	1116
<b>Intragrupo</b>	1	0	701	41	0	0	454	180	0	0	183	177
<b>Total</b>	113	113	3803	3803	111	111	3405	3405	86	86	2881	2881

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Otros agentes sin intragrupo

<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