

**Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2008**  
**Fecha de Información: 12 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\$684,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,4%.<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	153,6	256,2	108,2	146,0	148,0	7,6	409,8
15-35	107,0	71,6	56,6	61,1	12,0	42,9	175,6
36-60	34,8	9,6	9,6	34,8	-	-	44,4
61-90	2,2	27,6	27,6	2,2	-	-	29,8
91-180	8,7	9,5	9,5	8,7	-	-	18,3
>180	6,1	0,5	0,5	6,1	-	-	6,6
<b>Total</b>	<b>312,4</b>	<b>375,1</b>	<b>212,1</b>	<b>258,9</b>	<b>160,0</b>	<b>50,5</b>	<b>684,5</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	13,5 %	10,6 %	7,8 %	9,0 %
15-35	3,3 %	6,2 %	4,3 %	5,2 %
36-60	-	6,9 %	5,1 %	5,5 %
61-90	-	6,8 %	5,4 %	6,7 %
91-180	-	7,2 %	6,1 %	6,7 %
>180	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>3,4 %</b>	<b>8,6 %</b>	<b>6,5 %</b>	<b>7,4 %</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
Sector Financiero**	89	25	1742	2284	78	36	1766	2145	51	35	1616	1635
Otros***	23	89	1360	1478	36	78	1312	1352	35	51	1213	1195
Intragrupo	1	0	701	41	0	0	602	182	0	0	183	182
<b>Total</b>	<b>113</b>	<b>113</b>	<b>3803</b>	<b>3803</b>	<b>115</b>	<b>115</b>	<b>3680</b>	<b>3680</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>3012</b>	<b>3012</b>

\* 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