

**Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2008**  
**Fecha de Información: 19 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\$840,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.<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	197,0	207,1	206,7	144,3	-	52,4	403,8
15-35	215,0	140,9	85,6	153,0	23,4	30,0	323,9
36-60	3,2	19,0	18,9	3,1	-	-	22,1
61-90	7,7	48,4	48,4	7,6	-	-	56,0
91-180	14,3	14,0	14,0	14,3	-	-	28,3
>180	4,6	1,5	1,5	4,6	-	-	6,0
<b>Total</b>	<b>441,8</b>	<b>430,9</b>	<b>375,0</b>	<b>326,9</b>	<b>23,4</b>	<b>82,4</b>	<b>840,2</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	-16,3 %	-4,6 %	4,4 %	-0,7 %
15-35	6,8 %	10,4 %	12,3 %	11,1 %
36-60	1,3 %	5,0 %	7,2 %	5,3 %
61-90	3,5 %	6,9 %	8,9 %	7,1 %
91-180	-	6,7 %	4,6 %	5,6 %
>180	-	6,1 %	6,8 %	6,6 %
<b>Total</b>	<b>6,6 %</b>	<b>1,5 %</b>	<b>8,3 %</b>	<b>4,9 %</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	15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	80	39	1790	2189	58	36	2105	2388	61	19	1301	1307
<b>Otros***</b>	39	79	1354	1373	36	58	1655	1556	19	61	1032	1135
<b>Intragrupo</b>	0	0	604	185	0	0	453	269	0	0	206	96
<b>Total</b>	119	119	3748	3748	94	94	4213	4213	80	80	2539	2539

\* 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