

**Fecha de Publicación: 30 de Septiembre de 2008**  
**Fecha de Información: 26 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\$557,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.<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	230,6	19,6	19,3	147,3	-	83,0	249,9
15-35	157,0	166,1	89,1	120,0	40,0	-	286,1
36-60	2,7	0,6	0,6	2,7	-	-	3,3
61-90	1,1	0,6	0,6	1,1	-	-	1,7
91-180	2,0	6,0	6,0	2,0	-	-	8,0
>180	8,5	0,0	0,0	8,5	-	-	8,5
<b>Total</b>	<b>401,9</b>	<b>192,9</b>	<b>115,6</b>	<b>281,6</b>	<b>40,0</b>	<b>83,0</b>	<b>557,6</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 %	-5,1 %	-4,8 %	-4,8 %
15-35	8,3 %	2,7 %	3,9 %	4,1 %
36-60	-	12,6 %	5,6 %	7,0 %
61-90	-	6,0 %	4,5 %	5,0 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	-	6,4 %	6,4 %
<b>Total</b>	<b>8,4 %</b>	<b>1,8 %</b>	<b>-0,5 %</b>	<b>0,9 %</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	22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	55	36	2307	2547	66	24	1761	1926	57	20	1359	1793
<b>Otros***</b>	36	55	1734	1718	24	65	1300	1465	20	57	1288	1058
<b>Intragrupo</b>	0	0	533	309	0	1	510	181	0	0	310	107
<b>Total</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4574</b>	<b>4574</b>	<b>90</b>	<b>90</b>	<b>3572</b>	<b>3572</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>2958</b>	<b>2958</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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo