

**Fecha de Publicación: 7 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 03 de Octubre 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\$535,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,3%.<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	112,1	213,7	73,7	112,1	140,0	-	325,7
15-35	85,4	100,8	75,8	72,4	13,0	1,0	174,3
36-60	0,5	2,4	2,4	0,5	-	-	2,9
61-90	15,4	4,0	4,0	15,4	-	-	19,4
91-180	4,7	0,8	0,8	4,7	-	-	5,4
>180	1,1	6,3	6,3	1,1	-	-	7,4
<b>Total</b>	<b>219,2</b>	<b>328,0</b>	<b>163,0</b>	<b>206,2</b>	<b>153,0</b>	<b>1,0</b>	<b>535,2</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	-	12,3 %	-3,2 %	2,9 %
15-35	-6,8 %	5,3 %	2,8 %	3,3 %
36-60	-	6,5 %	1,6 %	5,6 %
61-90	-	9,2 %	4,9 %	5,8 %
91-180	-	7,2 %	4,6 %	5,0 %
>180	-	6,0 %	4,4 %	5,8 %
<b>Total</b>	<b>-6,8 %</b>	<b>8,6 %</b>	<b>-0,3 %</b>	<b>3,3 %</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	29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	66	24	1796	1958	58	21	1767	2229	59	28	906	1185
<b>Otros***</b>	24	65	1332	1499	21	58	1507	1351	28	59	835	725
<b>Intragrupo</b>	0	1	510	181	0	0	518	211	0	0	220	51
<b>Total</b>	<b>89</b>	<b>89</b>	<b>3638</b>	<b>3638</b>	<b>79</b>	<b>79</b>	<b>3792</b>	<b>3792</b>	<b>87</b>	<b>87</b>	<b>1961</b>	<b>1961</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