

**Fecha de Publicación: 9 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 07 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\$522,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	139,6	58,2	20,5	104,7	37,7	34,9	197,9
15-35	66,2	202,9	149,3	49,8	42,6	5,4	258,1
36-60	22,8	20,4	10,4	12,8	-	-	33,2
61-90	7,3	0,0	0,0	2,4	-	4,9	7,3
91-180	8,9	10,4	0,6	4,0	9,8	4,9	19,3
>180	6,2	0,0	0,0	6,2	-	-	6,2
<b>Total</b>	<b>251,0</b>	<b>292,0</b>	<b>180,8</b>	<b>179,8</b>	<b>90,1</b>	<b>50,2</b>	<b>522,0</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	-	11,0 %	-12,7 %	-9,3 %
15-35	2,5 %	9,4 %	1,8 %	7,2 %
36-60	0,9 %	7,6 %	8,1 %	5,8 %
61-90	-	2,0 %	4,4 %	4,4 %
91-180	-	9,0 %	5,8 %	6,3 %
>180	-	-	5,9 %	5,9 %
<b>Total</b>	<b>1,7 %</b>	<b>9,4 %</b>	<b>-2,9 %</b>	<b>4,0 %</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	6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	59	23	1879	2356	63	28	1007	1309	77	112	750	965
Otros***	23	59	1629	1438	28	63	929	810	112	77	743	591
Intragrupo	0	0	518	231	0	0	250	66	0	0	112	48
<b>Total</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>4026</b>	<b>4026</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>2186</b>	<b>2186</b>	<b>189</b>	<b>189</b>	<b>1605</b>	<b>1605</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo