

**Fecha de Publicación: 17 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 15 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\$735,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,7%.<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	117,1	203,5	47,1	110,7	150,0	-	314,2
15-35	69,7	291,7	258,1	53,7	17,6	-	345,3
36-60	1,3	1,0	1,0	1,3	-	-	2,3
61-90	3,0	6,1	0,1	3,0	6,0	-	9,1
91-180	12,0	8,2	8,2	12,0	-	-	20,2
>180	43,1	1,7	1,7	43,1	-	-	44,8
<b>Total</b>	<b>246,2</b>	<b>512,1</b>	<b>316,1</b>	<b>223,8</b>	<b>173,6</b>	<b>-</b>	<b>735,9</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	23,7 %	-7,9 %	9,8 %	5,3 %
15-35	6,6 %	8,4 %	4,5 %	7,7 %
36-60	-	8,9 %	5,6 %	7,0 %
61-90	-	5,0 %	7,8 %	7,7 %
91-180	-	5,4 %	4,3 %	4,8 %
>180	-	5,7 %	5,5 %	5,5 %
<b>Total</b>	<b>11,5 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>7,4 %</b>	<b>6,7 %</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	13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	65	34	1231	1618	75	118	1104	1352	50	38	976	1284
<b>Otros***</b>	34	65	1026	1010	118	75	907	872	38	50	908	747
<b>Intragrupo</b>	0	0	461	91	0	0	262	48	0	0	171	24
<b>Total</b>	99	99	2718	2718	193	193	2272	2272	88	88	2055	2055

\* 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