

**Fecha de Publicación: 21 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 17 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\$337,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.<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	77,8	37,7	37,6	77,7	-	-	115,4
15-35	86,2	63,9	53,9	57,9	-	18,2	140,1
36-60	1,8	17,0	17,0	1,7	-	-	18,7
61-90	4,4	1,4	1,4	4,4	-	-	5,8
91-180	0,2	12,5	12,5	0,2	-	-	12,7
>180	23,0	22,0	22,0	23,0	-	-	45,0
<b>Total</b>	<b>193,3</b>	<b>154,5</b>	<b>144,4</b>	<b>165,0</b>	<b>-</b>	<b>18,2</b>	<b>337,7</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	25,7 %	4,2 %	13,0 %	10,1 %
15-35	7,6 %	6,1 %	2,9 %	4,7 %
36-60	5,9 %	5,7 %	7,6 %	5,9 %
61-90	-	6,4 %	6,2 %	6,3 %
91-180	-	8,5 %	4,7 %	8,4 %
>180	-	6,7 %	6,4 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>7,6 %</b>	<b>5,8 %</b>	<b>8,2 %</b>	<b>7,1 %</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>	64	36	1231	1617	76	119	1266	1500	50	41	1054	1329
<b>Otros***</b>	36	64	1025	1010	119	76	1024	1034	41	50	946	825
<b>Intragrupo</b>	0	0	461	91	0	0	292	48	0	0	178	24
<b>Total</b>	100	100	2717	2717	195	195	2582	2582	91	91	2178	2178

\* 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