

**Fecha de Publicación: 23 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 21 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\$455,9 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	161,2	42,7	32,3	104,2	-	46,6	193,5
15-35	83,8	153,1	114,9	53,4	18,1	10,4	216,9
36-60	2,9	0,4	0,4	2,9	-	-	3,3
61-90	1,4	0,5	0,5	1,4	-	-	1,9
91-180	2,1	24,1	24,1	2,1	-	-	26,2
>180	0,3	13,9	13,9	0,3	-	-	14,1
<b>Total</b>	<b>251,6</b>	<b>234,7</b>	<b>186,2</b>	<b>164,2</b>	<b>18,1</b>	<b>57,0</b>	<b>455,9</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	10,7 %	-11,4 %	6,6 %	2,9 %
15-35	7,8 %	11,2 %	6,9 %	9,6 %
36-60	-	5,4 %	7,0 %	6,8 %
61-90	-	7,3 %	6,9 %	7,0 %
91-180	-	7,1 %	6,6 %	7,1 %
>180	-	6,5 %	4,0 %	6,4 %
<b>Total</b>	<b>8,8 %</b>	<b>6,4 %</b>	<b>6,7 %</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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	76	125	1380	1587	50	41	1170	1405	10	27	450	819
<b>Otros***</b>	125	76	1046	1097	41	50	989	923	27	9	613	351
<b>Intragrupo</b>	0	0	347	88	0	0	193	24	0	0	127	20
<b>Total</b>	202	202	2772	2772	91	91	2352	2352	37	37	1190	1190

\* 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