

**Fecha de Publicación: 4 de Diciembre de 2008**  
**Fecha de Información: 02 de Diciembre 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\$859,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,4%.<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	145,2	97,4	86,3	134,1	-	-	231,5
15-35	220,3	292,7	238,1	182,6	22,0	5,0	480,4
36-60	59,5	8,8	8,8	59,5	-	-	68,3
61-90	38,0	70,3	35,3	8,0	5,0	-	78,3
91-180	0,1	0,9	0,9	0,1	-	-	1,0
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
<b>Total</b>	<b>463,0</b>	<b>470,1</b>	<b>369,4</b>	<b>384,3</b>	<b>27,0</b>	<b>5,0</b>	<b>859,5</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	-1,3 %	9,6 %	13,6 %	11,4 %
15-35	6,5 %	9,2 %	4,9 %	7,3 %
36-60	-	5,3 %	6,2 %	6,1 %
61-90	7,2 %	7,6 %	7,5 %	7,4 %
91-180	-	7,9 %	7,0 %	7,8 %
>180	-	-	-	-
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>9,1 %</b>	<b>8,2 %</b>	<b>8,4 %</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	1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	121	22	1247	1429	22	21	1016	1020	13	35	976	1258
<b>Otros***</b>	22	121	908	985	21	22	803	794	35	13	976	802
<b>Intragrupo</b>	0	0	282	24	0	0	47	52	0	0	159	51
<b>Total</b>	144	144	2438	2438	43	43	1866	1866	47	47	2111	2111

\* 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