

**Fecha de Publicación: 16 de Diciembre de 2008**  
**Fecha de Información: 12 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\$583,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.<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	191,3	119,1	101,9	169,1	-	5,1	293,3
15-35	62,8	74,1	62,6	62,8	11,5	-	136,9
36-60	105,0	19,1	7,1	93,0	-	-	112,1
61-90	1,1	10,7	10,7	1,1	-	-	11,8
91-180	0,6	18,5	18,5	0,6	-	-	19,1
>180	0,0	10,4	10,4	0,0	-	-	10,4
<b>Total</b>	<b>360,8</b>	<b>251,8</b>	<b>211,2</b>	<b>326,6</b>	<b>11,5</b>	<b>5,1</b>	<b>583,5</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	-2,7 %	2,4 %	4,8 %	3,5 %
15-35	-	11,5 %	5,7 %	8,6 %
36-60	2,9 %	7,2 %	4,3 %	4,3 %
61-90	-	4,6 %	7,2 %	4,8 %
91-180	-	6,9 %	5,3 %	6,8 %
>180	-	4,7 %	-	4,7 %
<b>Total</b>	<b>-0,4 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>4,9 %</b>	<b>5,0 %</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	8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	35	22	1300	1245	67	48	1608	1733	94	33	541	556
<b>Otros***</b>	22	35	941	1012	48	67	1266	1329	33	94	407	455
<b>Intragrupo</b>	0	0	107	92	0	0	304	116	0	0	75	12
<b>Total</b>	57	57	2349	2349	115	115	3179	3179	127	127	1023	1023

\* 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