

**Fecha de Publicación: 22 de Agosto de 2008**  
**Fecha de Información: 20 de Agosto 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\$829,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,7%.<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	161,8	101,2	55,2	115,8	-	-	217,0
15-35	263,8	402,1	225,8	144,3	66,8	10,0	556,4
36-60	3,9	3,7	3,7	3,9	-	-	7,6
61-90	14,0	2,0	2,0	14,0	-	-	15,9
91-180	6,3	20,3	20,3	6,3	-	-	26,5
>180	4,9	1,1	1,1	4,9	-	-	6,0
<b>Total</b>	<b>454,7</b>	<b>530,3</b>	<b>308,0</b>	<b>289,2</b>	<b>66,8</b>	<b>10,0</b>	<b>829,5</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	30,0 %	-13,5 %	13,7 %	10,2 %
15-35	9,6 %	10,1 %	9,2 %	9,7 %
36-60	-	10,1 %	9,6 %	9,8 %
61-90	-	9,2 %	8,6 %	8,7 %
91-180	-	7,6 %	7,6 %	7,6 %
>180	-	8,0 %	7,5 %	7,6 %
<b>Total</b>	<b>15,6 %</b>	<b>5,7 %</b>	<b>10,9 %</b>	<b>9,7 %</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	18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	34	17	1413	1973	67	24	1753	2199	7	12	671	802
<b>Otros***</b>	17	34	1336	1145	24	67	1272	1278	12	7	576	505
<b>Intragrupo</b>	0	0	451	82	0	0	548	96	0	0	97	38
<b>Total</b>	51	51	3200	3200	92	92	3573	3573	19	19	1345	1345

\* 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