

**Fecha de Publicación: 5 de Septiembre de 2008**  
**Fecha de Información: 03 de Septiembre 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\$809,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,2%.<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	111,2	225,4	85,9	102,8	131,2	-	328,3
15-35	133,3	224,6	209,3	119,3	9,3	8,0	351,9
36-60	20,2	21,6	21,6	20,2	-	-	41,7
61-90	5,7	2,2	2,2	5,7	-	-	7,8
91-180	10,9	0,4	0,4	10,9	-	-	11,3
>180	12,8	55,2	55,2	12,8	-	-	68,0
<b>Total</b>	<b>294,1</b>	<b>529,3</b>	<b>374,5</b>	<b>271,7</b>	<b>140,5</b>	<b>8,0</b>	<b>809,0</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	9,0 %	2,1 %	-0,8 %	0,9 %
15-35	9,4 %	10,4 %	11,9 %	10,9 %
36-60	-	9,3 %	7,6 %	8,5 %
61-90	-	6,0 %	8,7 %	7,9 %
91-180	-	9,3 %	6,5 %	6,6 %
>180	-	6,7 %	7,0 %	6,7 %
<b>Total</b>	<b>9,1 %</b>	<b>7,8 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>7,2 %</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 Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	12	12	1062	1667	86	22	1287	1709	63	26	1181	1233
<b>Otros***</b>	12	12	989	862	21	86	1005	1028	25	63	859	841
<b>Intragrupo</b>	0	0	515	38	1	0	481	36	0	0	194	160
<b>Total</b>	24	24	2567	2567	109	109	2773	2773	88	88	2234	2234

\* 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:  $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo