

**Fecha de Publicación: 2 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 30 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\$518,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.<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	112,6	59,8	59,8	72,6	-	40,0	172,4
15-35	106,6	149,3	93,3	95,6	45,0	-	244,9
36-60	4,3	15,0	15,0	4,3	-	-	19,3
61-90	13,2	3,4	3,4	13,2	-	-	16,6
91-180	13,7	4,9	4,9	13,7	-	-	18,5
>180	11,8	35,1	35,1	11,8	-	-	46,9
<b>Total</b>	<b>262,2</b>	<b>267,4</b>	<b>211,4</b>	<b>211,2</b>	<b>45,0</b>	<b>40,0</b>	<b>518,6</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	-	14,7 %	5,9 %	9,8 %
15-35	8,2 %	0,6 %	-3,9 %	-1,1 %
36-60	-	8,1 %	6,4 %	7,7 %
61-90	-	7,4 %	4,5 %	5,1 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	6,8 %	5,9 %	6,6 %
<b>Total</b>	<b>8,2 %</b>	<b>6,4 %</b>	<b>1,3 %</b>	<b>4,0 %</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	29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	66	23	1792	1955	57	20	1561	1889	56	27	704	1107
<b>Otros***</b>	23	65	1329	1496	20	57	1374	1210	27	56	768	531
<b>Intragrupo</b>	0	1	510	181	0	0	310	147	0	0	210	43
<b>Total</b>	<b>88</b>	<b>88</b>	<b>3632</b>	<b>3632</b>	<b>77</b>	<b>77</b>	<b>3246</b>	<b>3246</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>1681</b>	<b>1681</b>

\* 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