

**Fecha de Publicación: 27 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 23 de Octubre 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\$525,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,7%.<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	123,5	45,1	45,1	83,5	-	40,0	168,6
15-35	90,0	246,4	176,1	76,4	57,3	0,6	323,3
36-60	1,8	6,8	6,8	1,7	-	-	8,5
61-90	7,2	2,3	2,3	7,2	-	-	9,4
91-180	0,7	10,1	10,1	0,7	-	-	10,7
>180	3,0	2,0	2,0	3,0	-	-	5,0
<b>Total</b>	<b>226,2</b>	<b>312,6</b>	<b>242,3</b>	<b>172,5</b>	<b>57,3</b>	<b>40,6</b>	<b>525,7</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	-	7,2 %	5,2 %	5,9 %
15-35	6,5 %	7,8 %	4,8 %	6,8 %
36-60	7,9 %	11,0 %	7,2 %	10,3 %
61-90	-	8,2 %	7,7 %	7,8 %
91-180	-	8,4 %	6,1 %	8,2 %
>180	-	7,1 %	6,2 %	6,5 %
<b>Total</b>	<b>6,5 %</b>	<b>7,8 %</b>	<b>5,2 %</b>	<b>6,7 %</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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	79	127	1385	1600	57	43	1295	1554	11	27	549	871
<b>Otros***</b>	127	79	1047	1090	43	56	1097	1003	27	11	655	440
<b>Intragrupo</b>	0	0	347	88	0	0	233	68	0	0	127	20
<b>Total</b>	<b>206</b>	<b>206</b>	<b>2779</b>	<b>2779</b>	<b>99</b>	<b>99</b>	<b>2625</b>	<b>2625</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>1332</b>	<b>1332</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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo