

**Fecha de Publicación: 29 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 27 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\$621,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,1%.<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	156,8	73,2	51,2	146,8	12,0	-	220,0
15-35	192,8	122,5	91,8	182,8	20,6	-	305,3
36-60	2,6	6,5	2,5	2,5	4,0	-	9,0
61-90	1,3	10,1	10,1	1,3	-	-	11,4
91-180	0,6	37,0	37,0	0,6	-	-	37,6
>180	1,0	37,4	37,4	1,0	-	-	38,4
<b>Total</b>	<b>355,0</b>	<b>286,7</b>	<b>230,0</b>	<b>335,0</b>	<b>36,6</b>	<b>-</b>	<b>621,6</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	9,2 %	-25,0 %	-6,0 %	-9,8 %
15-35	8,6 %	4,4 %	8,0 %	6,9 %
36-60	9,6 %	9,2 %	7,6 %	8,4 %
61-90	-	8,8 %	7,5 %	8,7 %
91-180	-	7,6 %	7,2 %	7,6 %
>180	-	7,4 %	2,3 %	7,3 %
<b>Total</b>	<b>8,9 %</b>	<b>-0,7 %</b>	<b>1,9 %</b>	<b>1,1 %</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	27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	56	45	1463	1634	12	28	651	949	37	21	617	891
<b>Otros***</b>	45	56	1165	1171	28	12	693	501	21	37	661	508
<b>Intragrupo</b>	0	0	245	68	0	0	127	20	0	0	152	31
<b>Total</b>	101	101	2873	2873	40	40	1471	1471	57	57	1430	1430

\* 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