

**Fecha de Publicación: 30 de Octubre de 2008**  
**Fecha de Información: 28 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\$648,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.<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	178,7	77,6	67,6	118,7	10,0	60,0	256,3
15-35	202,2	122,0	103,0	188,1	19,0	14,0	324,1
36-60	3,8	46,7	44,7	3,7	2,0	-	50,4
61-90	1,1	1,5	1,5	1,1	-	-	2,6
91-180	1,1	4,2	4,2	1,1	-	-	5,2
>180	5,2	5,0	5,0	5,2	-	-	10,2
<b>Total</b>	<b>392,0</b>	<b>257,0</b>	<b>225,9</b>	<b>317,9</b>	<b>31,0</b>	<b>74,0</b>	<b>648,9</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	-	-38,7 %	8,3 %	-9,8 %
15-35	12,6 %	7,8 %	6,5 %	6,9 %
36-60	10,1 %	9,2 %	10,8 %	9,4 %
61-90	-	6,1 %	9,9 %	7,7 %
91-180	-	5,5 %	8,8 %	6,2 %
>180	-	8,2 %	7,3 %	7,8 %
<b>Total</b>	<b>11,2 %</b>	<b>-5,7 %</b>	<b>7,2 %</b>	<b>1,7 %</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	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
Sector Financiero**	56	46	1507	1683	13	28	775	979	74	21	632	935
Otros***	45	56	1214	1215	28	13	713	566	21	74	705	524
Intragrupo	0	0	245	68	0	0	137	80	0	0	152	31
<b>Total</b>	<b>101</b>	<b>101</b>	<b>2967</b>	<b>2967</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>1625</b>	<b>1625</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>1489</b>	<b>1489</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:  $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo