

**Fecha de Publicación: 4 de Noviembre de 2008**  
**Fecha de Información: 30 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\$811,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.<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	168,3	163,6	62,0	166,7	100,0	-	330,3
15-35	186,5	272,5	206,5	157,5	37,0	-	429,9
36-60	3,9	26,5	26,5	3,9	-	-	30,4
61-90	1,1	5,5	5,3	0,9	-	-	6,4
91-180	0,4	4,5	2,7	0,4	1,8	-	4,9
>180	4,8	5,0	5,0	4,8	-	-	9,8
<b>Total</b>	<b>365,0</b>	<b>477,6</b>	<b>308,0</b>	<b>334,2</b>	<b>138,8</b>	<b>-</b>	<b>811,8</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	10,2 %	-13,4 %	11,2 %	5,1 %
15-35	5,5 %	8,8 %	0,7 %	5,3 %
36-60	-	2,8 %	12,8 %	4,1 %
61-90	3,9 %	7,5 %	2,6 %	6,7 %
91-180	-	10,7 %	7,3 %	10,2 %
>180	-	6,0 %	1,2 %	3,6 %
<b>Total</b>	<b>5,7 %</b>	<b>4,1 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>5,2 %</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	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	47	1506	1683	13	30	986	1202	104	29	864	1011
<b>Otros***</b>	47	55	1214	1214	30	13	834	775	29	104	751	645
<b>Intragrupo</b>	0	0	245	68	0	0	237	80	0	0	152	111
<b>Total</b>	102	102	2965	2965	44	44	2057	2057	133	133	1767	1767

\* 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