

**Fecha de Publicación: 6 de Noviembre de 2008**  
**Fecha de Información: 04 de Noviembre 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\$402,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.<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	112,4	54,5	54,3	82,3	0,2	30,0	166,8
15-35	109,3	116,8	88,8	85,3	6,0	2,0	204,1
36-60	5,1	5,9	5,9	5,1	-	-	11,0
61-90	1,5	4,7	4,7	1,5	-	-	6,2
91-180	0,1	13,6	13,6	0,1	-	-	13,7
>180	0,0	0,6	0,6	0,0	-	-	0,6
<b>Total</b>	<b>228,3</b>	<b>196,2</b>	<b>168,0</b>	<b>174,3</b>	<b>6,2</b>	<b>32,0</b>	<b>402,5</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	-	-3,9 %	4,0 %	0,9 %
15-35	7,3 %	14,0 %	5,0 %	9,4 %
36-60	-	6,9 %	7,9 %	7,4 %
61-90	-	6,9 %	6,7 %	6,8 %
91-180	-	8,5 %	4,0 %	8,5 %
>180	-	6,9 %	-	6,9 %
<b>Total</b>	<b>7,3 %</b>	<b>7,8 %</b>	<b>4,7 %</b>	<b>6,3 %</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	3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	13	32	1128	1270	105	33	920	1071	37	24	546	993
<b>Otros***</b>	31	13	872	827	33	105	800	701	24	37	721	439
<b>Intragrupo</b>	0	0	237	140	0	0	164	111	0	0	182	15
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>2238</b>	<b>2238</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>1883</b>	<b>1883</b>	<b>61</b>	<b>61</b>	<b>1448</b>	<b>1448</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) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo