

**Fecha de Publicación: 10 de Noviembre de 2008**  
**Fecha de Información: 06 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\$942,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.<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	160,6	101,5	65,0	159,2	35,1	-	260,7
15-35	225,1	358,6	193,8	184,0	153,7	30,0	572,6
36-60	22,2	27,6	27,6	22,2	-	-	49,8
61-90	3,1	2,9	2,9	3,1	-	-	5,9
91-180	6,5	9,4	3,4	0,5	-	-	9,9
>180	3,2	40,5	40,5	3,2	-	-	43,7
<b>Total</b>	<b>420,6</b>	<b>540,4</b>	<b>333,1</b>	<b>372,2</b>	<b>188,8</b>	<b>30,0</b>	<b>942,6</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	21,5 %	0,7 %	7,3 %	5,5 %
15-35	6,1 %	6,9 %	5,6 %	6,3 %
36-60	-	9,6 %	6,4 %	8,1 %
61-90	-	8,0 %	3,7 %	5,8 %
91-180	7,8 %	6,5 %	7,2 %	7,3 %
>180	-	7,0 %	3,5 %	6,8 %
<b>Total</b>	<b>7,8 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>6,2 %</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	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>	14	31	1128	1292	105	35	1178	1326	38	25	656	1043
<b>Otros***</b>	30	14	894	827	35	105	946	936	25	38	770	549
<b>Intragrupo</b>	0	0	237	140	0	0	249	111	0	0	182	15
<b>Total</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>2259</b>	<b>2259</b>	<b>139</b>	<b>139</b>	<b>2373</b>	<b>2373</b>	<b>62</b>	<b>62</b>	<b>1607</b>	<b>1607</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