

**Fecha de Publicación: 11 de Noviembre de 2008**  
**Fecha de Información: 07 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\$467,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.<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	118,7	115,3	63,6	72,0	5,0	-	187,3
15-35	96,0	182,9	124,9	37,0	-	1,0	220,9
36-60	0,4	13,1	13,1	0,4	-	-	13,5
61-90	3,0	13,4	13,4	3,0	-	-	16,4
91-180	20,4	25,1	5,1	0,4	-	-	25,5
>180	0,3	4,0	4,0	0,3	-	-	4,3
<b>Total</b>	<b>238,8</b>	<b>353,8</b>	<b>224,0</b>	<b>113,1</b>	<b>5,0</b>	<b>1,0</b>	<b>467,9</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	11,3 %	1,0 %	2,2 %	4,5 %
15-35	7,2 %	5,4 %	5,3 %	5,9 %
36-60	-	5,5 %	-0,6 %	5,3 %
61-90	-	5,4 %	6,2 %	5,6 %
91-180	5,2 %	6,8 %	5,4 %	5,5 %
>180	-	7,5 %	6,4 %	7,4 %
<b>Total</b>	<b>8,4 %</b>	<b>4,4 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>5,3 %</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	30	1128	1292	106	36	1256	1402	38	26	694	1080
<b>Otros***</b>	30	13	894	827	35	106	1001	993	26	38	777	562
<b>Intragrupo</b>	0	0	237	140	0	0	249	111	0	0	187	15
<b>Total</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>2259</b>	<b>2259</b>	<b>141</b>	<b>141</b>	<b>2506</b>	<b>2506</b>	<b>65</b>	<b>65</b>	<b>1657</b>	<b>1657</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