

**Fecha de Publicación: 16 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 14 de Noviembre de 2007 <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\$590,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado 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	42,3	66,4	26,4	42,3	40,0	-	108,7
15-35	197,6	288,2	174,2	158,6	80,0	5,0	451,8
36-60	1,6	0,6	0,6	1,6	-	-	2,2
61-90	21,0	2,6	2,6	21,0	-	-	23,6
91-180	0,1	1,1	1,1	0,1	-	-	1,2
>180	2,2	0,2	0,2	2,2	-	-	2,5
<b>Total</b>	<b>264,8</b>	<b>359,2</b>	<b>205,2</b>	<b>225,8</b>	<b>120,0</b>	<b>5,0</b>	<b>590,0</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	-	6,8 %	3,6 %	4,8 %
15-35	7,3 %	7,5 %	5,3 %	6,5 %
36-60	-	7,7 %	3,0 %	4,3 %
61-90	-	5,5 %	5,0 %	5,1 %
91-180	-	5,8 %	2,9 %	5,6 %
>180	-	5,1 %	4,2 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>7,3 %</b>	<b>7,4 %</b>	<b>4,9 %</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**

Sectores	12 al 16 de Noviembre				19 al 23 de Noviembre				26 al 30 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	24	59	1027	1554	19	25	1022	1192	16	40	703	947
<b>Otros***</b>	39	24	987	846	25	19	981	898	40	16	693	568
<b>Intragrupo</b>	21	0	485	99	0	0	119	32	0	0	136	17
<b>Total</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>2499</b>	<b>2499</b>	<b>45</b>	<b>45</b>	<b>2122</b>	<b>2122</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>1532</b>	<b>1532</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:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo