

**Fecha de Publicación: 19 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 15 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\$912,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,0%.<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	53,9	138,0	12,0	53,9	126,0	-	191,9
15-35	259,6	437,3	386,8	242,6	33,5	-	679,9
36-60	0,9	0,0	0,0	0,9	-	-	0,9
61-90	4,1	7,0	7,0	4,1	-	-	11,1
91-180	15,2	6,4	2,4	6,2	-	5,0	17,5
>180	5,6	9,0	0,0	1,6	5,0	-	10,6
<b>Total</b>	<b>339,3</b>	<b>597,7</b>	<b>408,2</b>	<b>309,3</b>	<b>164,5</b>	<b>5,0</b>	<b>912,0</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	-	5,7 %	4,8 %	5,0 %
15-35	3,9 %	6,0 %	3,5 %	5,0 %
36-60	-	7,8 %	5,0 %	5,1 %
61-90	-	5,9 %	4,6 %	5,4 %
91-180	4,2 %	5,2 %	5,2 %	4,9 %
>180	4,5 %	5,0 %	4,8 %	4,6 %
<b>Total</b>	<b>4,1 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>3,8 %</b>	<b>5,0 %</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	22	25	1048	1324	16	40	728	959
<b>Otros***</b>	39	24	987	846	25	22	987	924	40	16	705	594
<b>Intragrupo</b>	21	0	485	99	0	0	245	32	0	0	136	17
<b>Total</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>2499</b>	<b>2499</b>	<b>48</b>	<b>48</b>	<b>2280</b>	<b>2280</b>	<b>57</b>	<b>57</b>	<b>1570</b>	<b>1570</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