

**Fecha de Publicación: 26 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 22 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\$121,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,4%.<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	22,4	1,4	1,4	22,4	-	-	23,8
15-35	37,9	56,0	44,0	25,9	-	-	81,9
36-60	0,8	0,1	0,1	0,8	-	-	0,9
61-90	2,2	0,2	0,2	2,2	-	-	2,3
91-180	6,5	1,6	1,6	6,5	-	-	8,1
>180	4,1	0,0	0,0	4,1	-	-	4,1
<b>Total</b>	<b>73,9</b>	<b>59,3</b>	<b>47,3</b>	<b>61,9</b>	-	-	<b>121,1</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	-	-11,1 %	1,8 %	1,1 %
15-35	6,8 %	8,4 %	4,0 %	6,8 %
36-60	-	8,0 %	4,3 %	4,7 %
61-90	-	7,1 %	4,7 %	4,9 %
91-180	-	5,6 %	4,4 %	4,6 %
>180	-	-	4,2 %	4,2 %
<b>Total</b>	<b>6,8 %</b>	<b>7,7 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>5,4 %</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	19 al 23 de Noviembre				26 al 30 de Noviembre				3 al 7 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	25	1183	1464	19	41	1045	1258	12	27	716	1007
<b>Otros***</b>	25	25	1083	1059	41	19	849	886	27	12	652	530
<b>Intragrupo</b>	0	0	289	32	0	0	292	42	0	0	200	31
<b>Total</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>2555</b>	<b>2555</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>2186</b>	<b>2186</b>	<b>39</b>	<b>39</b>	<b>1569</b>	<b>1569</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