

**Fecha de Publicación: 29 de Noviembre de 2007**  
**Fecha de Información: 27 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\$672,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 3,7%.<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	101,0	222,6	97,6	88,0	112,0	-	310,6
15-35	190,5	91,2	46,4	152,5	11,8	5,0	248,7
36-60	16,4	52,1	52,1	16,4	-	-	68,5
61-90	8,1	1,8	1,8	8,1	-	-	10,0
91-180	22,6	6,0	6,0	22,6	-	-	28,7
>180	5,7	0,1	0,1	5,7	-	-	5,8
<b>Total</b>	<b>344,4</b>	<b>373,8</b>	<b>204,0</b>	<b>293,4</b>	<b>123,8</b>	<b>5,0</b>	<b>672,2</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	7,9 %	-6,0 %	8,4 %	1,3 %
15-35	6,8 %	7,7 %	3,4 %	4,8 %
36-60	-	5,9 %	6,9 %	6,1 %
61-90	-	4,6 %	5,2 %	5,1 %
91-180	-	6,0 %	5,2 %	5,4 %
>180	-	6,2 %	4,3 %	4,3 %
<b>Total</b>	<b>7,1 %</b>	<b>0,6 %</b>	<b>5,3 %</b>	<b>3,7 %</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	26 al 30 de Noviembre				3 al 7 de Diciembre				10 al 14 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	20	41	1116	1520	13	28	832	1248	61	33	774	1261
<b>Otros***</b>	41	20	971	956	28	13	736	586	33	61	942	641
<b>Intragrupo</b>	0	0	432	42	0	0	297	31	0	0	216	30
<b>Total</b>	60	60	2519	2519	40	40	1865	1865	94	94	1932	1932

\* 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