

Fecha de Publicación: 21 de Diciembre de 2007  
 Fecha de Información: 19 de Diciembre 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\$571,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,1%.<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	60,8	176,4	27,9	49,8	142,5	5,0	231,2
15-35	103,1	176,3	136,3	83,1	20,0	-	259,4
36-60	6,8	1,4	1,4	6,8	-	-	8,2
61-90	11,0	13,3	13,3	11,0	-	-	24,3
91-180	22,5	22,0	12,0	12,5	-	-	34,5
>180	13,2	7,7	0,7	6,2	-	-	13,9
<b>Total</b>	<b>217,3</b>	<b>397,2</b>	<b>191,7</b>	<b>169,4</b>	<b>162,5</b>	<b>5,0</b>	<b>571,5</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	2,8 %	6,5 %	5,1 %	5,4 %
15-35	7,4 %	9,0 %	6,8 %	8,1 %
36-60	-	6,4 %	6,0 %	6,0 %
61-90	-	6,6 %	6,6 %	6,6 %
91-180	5,9 %	5,8 %	5,1 %	5,6 %
>180	5,4 %	6,5 %	5,1 %	5,3 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>8,2 %</b>	<b>6,1 %</b>	<b>7,1 %</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	17 al 21 de Diciembre				24 al 28 de Diciembre				31 de Dic. al 4 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	111	55	1550	2534	14	17	742	921	21	9	596	633
<b>Otros***</b>	55	111	1262	1035	17	14	524	557	9	21	447	490
<b>Intragrupo</b>	0	0	1000	243	0	0	226	15	0	0	90	10
<b>Total</b>	166	166	3812	3812	31	31	1493	1493	30	30	1132	1132

\* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo