

Fecha de Publicación: 26 de Diciembre de 2007  
 Fecha de Información: 21 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\$413,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,5%.<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	46,9	142,0	48,0	46,9	94,0	-	188,9
15-35	103,9	85,8	54,8	88,9	16,0	-	174,7
36-60	8,0	4,9	4,9	8,0	-	-	12,9
61-90	0,0	11,3	11,3	0,0	-	-	11,3
91-180	0,0	19,3	19,3	0,0	-	-	19,3
>180	0,3	5,9	5,9	0,3	-	-	6,2
<b>Total</b>	<b>159,2</b>	<b>269,2</b>	<b>144,2</b>	<b>144,2</b>	<b>110,0</b>	<b>-</b>	<b>413,4</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	-	0,5 %	12,9 %	6,6 %
15-35	5,8 %	7,3 %	5,9 %	6,4 %
36-60	-	8,0 %	7,0 %	7,4 %
61-90	-	6,0 %	-	6,0 %
91-180	-	6,7 %	-	6,7 %
>180	-	5,7 %	4,9 %	5,7 %
<b>Total</b>	<b>5,8 %</b>	<b>4,8 %</b>	<b>8,3 %</b>	<b>6,5 %</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>	109	49	1549	2538	14	19	837	1290	20	9	612	651
<b>Otros***</b>	49	109	1266	1033	19	14	585	647	9	20	461	506
<b>Intragrupo</b>	0	0	1000	243	0	0	530	15	0	0	95	10
<b>Total</b>	159	159	3814	3814	32	32	1952	1952	30	30	1167	1167

\* 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