

Fecha de Publicación: 8 de Enero de 2008  
 Fecha de Información: 3 de Enero de 2008 <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\$690,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,3%.<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	152,4	90,5	50,5	102,4	30,0	40,0	232,8
15-35	97,5	247,4	194,6	90,5	45,8	-	337,9
36-60	31,7	1,1	1,1	31,7	-	-	32,8
61-90	3,5	2,1	2,1	3,5	-	-	5,5
91-180	10,6	77,6	57,6	0,6	10,0	-	78,2
>180	0,2	3,1	3,1	0,2	-	-	3,3
<b>Total</b>	<b>295,8</b>	<b>421,7</b>	<b>308,9</b>	<b>228,8</b>	<b>85,8</b>	<b>40,0</b>	<b>690,5</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	10,5 %	4,6 %	-0,1 %	2,0 %
15-35	6,8 %	7,3 %	6,7 %	7,1 %
36-60	-	7,4 %	4,8 %	4,9 %
61-90	-	6,2 %	3,9 %	4,7 %
91-180	6,3 %	5,3 %	5,2 %	5,5 %
>180	-	5,2 %	4,8 %	5,2 %
<b>Total</b>	<b>8,0 %</b>	<b>6,5 %</b>	<b>3,4 %</b>	<b>5,3 %</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	31 de Dic. al 4 de Enero				7 al 11 de Enero				14 al 18 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	10	807	1089	35	17	1172	1629	20	33	1139	1498
<b>Otros***</b>	10	22	604	686	17	35	980	920	33	20	1084	903
<b>Intragrupo</b>	0	0	374	10	0	0	410	12	0	0	229	50
<b>Total</b>	<b>33</b>	<b>33</b>	<b>1785</b>	<b>1785</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>2562</b>	<b>2562</b>	<b>53</b>	<b>53</b>	<b>2451</b>	<b>2451</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