

**Fecha de Publicación: 17 de Enero de 2008**  
**Fecha de Información: 15 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\$1192,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,7%.<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	157,3	246,3	111,3	98,4	135,0	58,9	403,6
15-35	280,9	346,6	272,6	220,9	59,0	45,0	612,5
36-60	16,2	78,3	5,4	12,2	68,9	-	90,4
61-90	0,0	5,1	5,1	0,0	-	-	5,1
91-180	24,8	26,4	26,4	24,8	-	-	51,1
>180	0,4	29,8	29,8	0,4	-	-	30,2
<b>Total</b>	<b>479,5</b>	<b>732,4</b>	<b>450,5</b>	<b>356,6</b>	<b>262,9</b>	<b>103,9</b>	<b>1192,9</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	-	3,2 %	-0,7 %	1,6 %
15-35	7,0 %	7,0 %	3,9 %	5,6 %
36-60	3,6 %	8,4 %	4,7 %	5,4 %
61-90	-	6,3 %	-	6,3 %
91-180	-	7,2 %	5,8 %	6,5 %
>180	-	6,0 %	4,5 %	6,0 %
<b>Total</b>	<b>6,3 %</b>	<b>6,0 %</b>	<b>3,0 %</b>	<b>4,7 %</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**

Sectores	14 al 18 de Enero				21 al 25 de Enero				28 de Ene. al 1 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	93	50	1922	2418	15	30	765	855	9	37	633	685
Otros***	50	93	1469	1510	30	15	657	561	37	9	521	527
Intragrupo	0	0	728	191	0	0	114	119	0	0	93	35
<b>Total</b>	<b>144</b>	<b>144</b>	<b>4120</b>	<b>4120</b>	<b>44</b>	<b>44</b>	<b>1535</b>	<b>1535</b>	<b>46</b>	<b>46</b>	<b>1247</b>	<b>1247</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