

**Fecha de Publicación: 25 de Enero de 2008**  
**Fecha de Información: 23 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\$539,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11,2%.<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	82,9	134,3	134,3	82,9	-	-	217,2
15-35	170,1	157,6	116,6	129,1	1,0	1,0	287,7
36-60	2,6	0,1	0,1	2,6	-	-	2,7
61-90	11,9	6,7	6,7	11,9	-	-	18,6
91-180	3,1	1,0	1,0	3,1	-	-	4,1
>180	6,9	2,0	2,0	6,9	-	-	9,0
<b>Total</b>	<b>277,5</b>	<b>301,7</b>	<b>260,7</b>	<b>236,5</b>	<b>1,0</b>	<b>1,0</b>	<b>539,2</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	-	12,0 %	20,4 %	15,0 %
15-35	4,8 %	9,0 %	10,2 %	9,0 %
36-60	-	5,6 %	9,9 %	9,7 %
61-90	-	6,2 %	7,1 %	6,7 %
91-180	-	9,0 %	5,3 %	6,2 %
>180	-	6,5 %	7,0 %	6,9 %
<b>Total</b>	<b>4,8 %</b>	<b>10,4 %</b>	<b>13,3 %</b>	<b>11,2 %</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	21 al 25 de Enero				28 de Ene. al 1 de Febrero				4 al 8 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	21	30	1324	2140	12	37	870	972	26	27	887	1025
<b>Otros***</b>	30	21	1137	1120	37	12	773	743	27	26	705	679
<b>Intragrupo</b>	0	0	918	119	0	0	107	35	0	0	145	32
<b>Total</b>	51	51	3379	3379	49	49	1750	1750	53	53	1736	1736

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