

**Fecha de Publicación: 28 de Enero de 2008**  
**Fecha de Información: 24 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\$919,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,2%.<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	69,9	265,8	65,8	49,9	180,0	-	315,7
15-35	207,8	319,4	261,4	159,8	13,0	3,0	482,2
36-60	2,6	2,4	2,4	2,6	-	-	5,0
61-90	48,2	38,7	26,7	36,2	-	-	74,9
91-180	5,0	7,0	7,0	5,0	-	-	12,0
>180	20,6	19,4	9,4	10,6	-	-	30,0
<b>Total</b>	<b>354,1</b>	<b>652,7</b>	<b>372,7</b>	<b>264,1</b>	<b>193,0</b>	<b>3,0</b>	<b>919,8</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	24,1 %	5,4 %	12,3 %	10,7 %
15-35	9,8 %	9,5 %	8,0 %	9,0 %
36-60	-	8,4 %	8,8 %	8,6 %
61-90	9,2 %	8,0 %	9,5 %	8,9 %
91-180	-	7,3 %	7,1 %	7,2 %
>180	7,0 %	6,8 %	7,0 %	6,9 %
<b>Total</b>	<b>12,7 %</b>	<b>8,6 %</b>	<b>9,0 %</b>	<b>9,2 %</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**

Sector	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	11	38	907	1189	26	26	922	1075
<b>Otros***</b>	30	21	1137	1121	38	11	810	780	26	26	734	694
<b>Intragrupo</b>	0	0	918	119	0	0	287	35	0	0	145	32
<b>Total</b>	52	52	3379	3379	50	50	2004	2004	52	52	1801	1801

\* 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