

**Fecha de Publicación: 29 de Enero de 2008**  
**Fecha de Información: 25 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\$924,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.<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	128,5	374,4	68,4	46,1	260,0	36,4	456,9
15-35	184,3	236,7	153,3	139,3	38,4	-	376,0
36-60	48,1	32,8	2,8	18,1	-	-	50,8
61-90	17,0	14,4	2,4	5,0	-	-	19,4
91-180	1,0	18,2	18,2	1,0	-	-	19,2
>180	0,0	2,3	2,3	0,0	-	-	2,3
<b>Total</b>	<b>378,9</b>	<b>678,8</b>	<b>247,5</b>	<b>209,5</b>	<b>298,4</b>	<b>36,4</b>	<b>924,8</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	-0,7 %	2,7 %	13,3 %	4,8 %
15-35	12,7 %	8,5 %	6,9 %	8,4 %
36-60	6,7 %	6,3 %	6,8 %	6,7 %
61-90	6,2 %	7,8 %	9,1 %	7,1 %
91-180	-	8,2 %	6,6 %	8,1 %
>180	-	6,3 %	7,0 %	6,3 %
<b>Total</b>	<b>6,1 %</b>	<b>6,8 %</b>	<b>8,4 %</b>	<b>7,2 %</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	28	1325	2142	11	39	1004	1520	26	26	955	1118
<b>Otros***</b>	28	21	1139	1122	39	11	851	810	26	26	762	711
<b>Intragrupo</b>	0	0	918	119	0	0	547	71	0	0	145	32
<b>Total</b>	<b>49</b>	<b>49</b>	<b>3382</b>	<b>3382</b>	<b>50</b>	<b>50</b>	<b>2402</b>	<b>2402</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>1861</b>	<b>1861</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