

**Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2008**  
**Fecha de Información: 29 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\$670,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,7%.<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	108,4	180,4	30,4	108,4	150,0	-	288,7
15-35	106,9	191,6	161,6	91,9	15,0	-	283,5
36-60	10,9	15,6	15,6	10,9	-	-	26,5
61-90	8,9	15,4	7,1	0,6	-	-	16,0
91-180	0,9	12,2	11,5	0,2	-	-	12,4
>180	25,6	17,5	17,5	15,6	-	10,0	43,1
<b>Total</b>	<b>261,5</b>	<b>432,7</b>	<b>243,7</b>	<b>227,5</b>	<b>165,0</b>	<b>10,0</b>	<b>670,3</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	-	11,6 %	8,6 %	9,2 %
15-35	6,1 %	9,8 %	7,4 %	8,8 %
36-60	-	8,4 %	8,8 %	8,5 %
61-90	4,6 %	7,8 %	11,7 %	6,3 %
91-180	6,5 %	7,3 %	6,7 %	7,2 %
>180	-	7,6 %	7,1 %	7,3 %
<b>Total</b>	<b>5,6 %</b>	<b>9,6 %</b>	<b>8,0 %</b>	<b>8,7 %</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	28 de Ene. al 1 de Febrero				4 al 8 de Febrero				11 al 15 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	11	39	1109	1730	27	28	1041	1153	57	39	1373	1621
<b>Otros***</b>	39	11	910	896	28	27	786	782	39	57	1189	1048
<b>Intragrupo</b>	0	0	697	91	0	0	145	37	0	0	134	27
<b>Total</b>	49	49	2716	2716	55	55	1972	1972	96	96	2696	2696

\* 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