

**Fecha de Publicación: 5 de Febrero de 2008**  
**Fecha de Información: 1 de Febrero 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\$537,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,3%.<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	185,9	55,9	67,9	115,0	-	253,8
15-35	118,9	172,3	103,3	53,9	4,0	-	226,2
36-60	0,9	10,4	10,4	0,9	-	-	11,3
61-90	0,1	19,2	19,2	0,1	-	-	19,2
91-180	13,1	11,8	11,8	13,1	-	-	24,9
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	-	-	2,0
<b>Total</b>	<b>215,9</b>	<b>401,6</b>	<b>202,5</b>	<b>135,9</b>	<b>119,0</b>	<b>-</b>	<b>537,5</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	10,2 %	8,4 %	4,6 %	6,8 %
15-35	7,0 %	8,2 %	7,2 %	7,6 %
36-60	-	7,6 %	7,8 %	7,6 %
61-90	-	7,8 %	7,5 %	7,8 %
91-180	7,1 %	7,6 %	6,7 %	7,1 %
>180	-	7,7 %	-	7,7 %
<b>Total</b>	<b>7,6 %</b>	<b>8,1 %</b>	<b>5,9 %</b>	<b>7,3 %</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>	10	29	1113	1743	31	25	1395	1451	61	41	1476	1768
<b>Otros***</b>	29	10	923	899	25	31	944	1029	41	61	1335	1151
<b>Intragrupo</b>	0	0	697	91	0	0	270	130	0	0	134	27
<b>Total</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>2733</b>	<b>2733</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>2609</b>	<b>2609</b>	<b>103</b>	<b>103</b>	<b>2946</b>	<b>2946</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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo