

Fecha de Publicación: 11 de Febrero de 2008  
 Fecha de Información: 7 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\$1374,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.<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	288,5	511,3	160,8	206,4	320,0	51,6	769,3
15-35	179,7	326,3	235,1	122,2	33,7	-	448,5
36-60	46,5	102,6	21,0	16,5	51,6	-	119,1
61-90	1,1	10,4	10,4	1,1	-	-	11,5
91-180	14,4	14,0	6,0	6,4	-	-	20,5
>180	5,5	0,0	0,0	5,5	-	-	5,5
<b>Total</b>	<b>535,7</b>	<b>964,7</b>	<b>433,4</b>	<b>358,1</b>	<b>405,4</b>	<b>51,6</b>	<b>1374,5</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	-7,4 %	0,1 %	12,2 %	5,8 %
15-35	11,2 %	10,3 %	5,8 %	9,1 %
36-60	6,7 %	6,5 %	7,2 %	6,7 %
61-90	-	9,6 %	8,6 %	9,5 %
91-180	4,4 %	7,2 %	7,2 %	6,1 %
>180	-	8,1 %	6,9 %	6,9 %
<b>Total</b>	<b>5,2 %</b>	<b>6,3 %</b>	<b>9,6 %</b>	<b>7,4 %</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	4 al 8 de Febrero				11 al 15 de Febrero				18 al 22 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	36	20	1508	1558	69	38	1951	2440	37	23	1326	1412
<b>Otros***</b>	20	36	1038	1107	38	69	1605	1472	23	37	1063	1074
<b>Intragrupo</b>	0	0	270	151	0	0	492	136	0	0	99	1
<b>Total</b>	<b>56</b>	<b>56</b>	<b>2816</b>	<b>2816</b>	<b>107</b>	<b>107</b>	<b>4048</b>	<b>4048</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>2488</b>	<b>2488</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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo