

**Fecha de Publicación: 4 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 02 de Julio 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\$1681,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,2%.<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	144,8	414,7	86,6	144,7	328,0	-	559,4
15-35	468,1	403,0	270,9	416,1	112,1	32,0	851,1
36-60	35,8	6,4	6,4	35,8	-	-	42,2
61-90	13,1	1,2	1,2	13,1	-	-	14,3
91-180	16,6	33,5	33,4	16,6	-	-	50,0
>180	63,2	101,3	101,3	63,2	-	-	164,5
<b>Total</b>	<b>741,7</b>	<b>960,1</b>	<b>499,8</b>	<b>689,5</b>	<b>440,1</b>	<b>32,0</b>	<b>1681,7</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	55,5 %	4,2 %	13,8 %	10,1 %
15-35	10,5 %	9,8 %	6,7 %	8,0 %
36-60	-	3,6 %	9,2 %	8,4 %
61-90	-	2,7 %	6,1 %	5,8 %
91-180	9,1 %	6,6 %	6,6 %	6,6 %
>180	-	7,5 %	6,6 %	7,2 %
<b>Total</b>	<b>10,8 %</b>	<b>8,0 %</b>	<b>8,2 %</b>	<b>8,2 %</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	30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	17	1651	1972	70	21	2088	2792	100	25	1370	1701
Otros***	17	44	1107	1318	21	70	1530	1685	25	100	999	1079
Intragrupo	0	0	643	112	0	0	972	112	0	0	459	48
<b>Total</b>	<b>61</b>	<b>61</b>	<b>3401</b>	<b>3401</b>	<b>91</b>	<b>91</b>	<b>4590</b>	<b>4590</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>2828</b>	<b>2828</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