

**Fecha de Publicación: 8 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 04 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\$73,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,5%.<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	6,1	7,9	7,6	5,8	-	-	13,7
15-35	48,6	5,6	5,5	48,5	-	-	54,1
36-60	1,4	0,8	0,8	1,4	-	-	2,2
61-90	0,3	0,1	0,1	0,3	-	-	0,4
91-180	0,1	2,3	2,3	0,1	-	-	2,4
>180	0,2	0,1	0,1	0,2	-	-	0,3
<b>Total</b>	<b>56,7</b>	<b>16,7</b>	<b>16,4</b>	<b>56,3</b>	-	-	<b>73,0</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	-2,4 %	-2,6 %	25,6 %	9,4 %
15-35	5,1 %	12,5 %	6,4 %	7,0 %
36-60	-	9,4 %	5,4 %	6,8 %
61-90	-	15,2 %	8,9 %	10,6 %
91-180	-	9,6 %	6,4 %	9,5 %
>180	-	9,8 %	10,1 %	10,0 %
<b>Total</b>	<b>-1,3 %</b>	<b>5,0 %</b>	<b>8,3 %</b>	<b>7,5 %</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**	43	17	1652	1972	70	22	2217	2960	100	25	1421	1738
Otros***	17	43	1107	1318	22	70	1607	1790	25	100	1020	1114
Intragrupo	0	0	643	112	0	0	1038	112	0	0	459	48
<b>Total</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>3402</b>	<b>3402</b>	<b>92</b>	<b>92</b>	<b>4862</b>	<b>4862</b>	<b>125</b>	<b>125</b>	<b>2900</b>	<b>2900</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