

**Fecha de Publicación: 11 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 09 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\$713,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.<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	174,8	85,5	34,0	128,3	5,0	-	213,8
15-35	231,5	221,2	142,2	149,5	22,0	25,0	395,7
36-60	4,5	0,9	0,9	4,5	-	-	5,4
61-90	0,0	2,7	2,7	0,0	-	-	2,7
91-180	0,4	13,7	13,7	0,4	-	-	14,1
>180	5,0	82,1	52,1	0,0	25,0	-	82,1
<b>Total</b>	<b>416,2</b>	<b>406,0</b>	<b>245,5</b>	<b>282,7</b>	<b>52,0</b>	<b>25,0</b>	<b>713,7</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	-8,0 %	0,8 %	8,7 %	3,6 %
15-35	10,8 %	8,0 %	8,9 %	8,9 %
36-60	-	6,9 %	8,3 %	8,1 %
61-90	-	7,5 %	-	7,5 %
91-180	-	8,2 %	8,1 %	8,2 %
>180	8,7 %	8,8 %	-	8,8 %
<b>Total</b>	<b>2,7 %</b>	<b>7,2 %</b>	<b>8,8 %</b>	<b>7,1 %</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	7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	75	22	2558	3186	100	24	1747	1981	95	37	1210	1690
Otros***	22	75	1703	2071	24	100	1175	1364	37	95	1230	972
Intragrupo	0	0	1168	172	0	0	475	53	0	0	298	75
<b>Total</b>	<b>96</b>	<b>96</b>	<b>5428</b>	<b>5428</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>3397</b>	<b>3397</b>	<b>132</b>	<b>132</b>	<b>2738</b>	<b>2738</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:  $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo