

**Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 17 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\$1137,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.<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	229,5	322,7	83,7	153,5	163,0	-	476,2
15-35	240,6	413,7	322,3	178,6	49,4	20,0	612,2
36-60	10,2	1,0	1,0	10,2	-	-	11,2
61-90	0,1	6,5	6,5	0,1	-	-	6,6
91-180	0,3	6,0	6,0	0,3	-	-	6,3
>180	0,0	25,0	25,0	0,0	-	-	25,0
<b>Total</b>	<b>480,6</b>	<b>774,8</b>	<b>444,4</b>	<b>342,6</b>	<b>212,4</b>	<b>20,0</b>	<b>1137,5</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	5,7 %	5,5 %	7,0 %	6,3 %
15-35	9,4 %	10,4 %	6,5 %	9,0 %
36-60	-	8,2 %	9,3 %	9,2 %
61-90	-	8,1 %	7,9 %	8,1 %
91-180	-	9,0 %	10,3 %	9,1 %
>180	-	8,0 %	-	8,0 %
<b>Total</b>	<b>7,0 %</b>	<b>9,3 %</b>	<b>6,8 %</b>	<b>8,0 %</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	14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	113	20	2051	2884	96	37	1850	2199	42	13	1501	1585
<b>Otros***</b>	20	113	1525	1618	37	96	1500	1464	13	42	1085	1265
<b>Intragrupo</b>	0	0	1008	82	0	0	390	77	0	0	336	72
<b>Total</b>	133	133	4584	4584	133	133	3741	3741	55	55	2921	2921

\* 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