

**Fecha de Publicación: 27 de Febrero de 2008**  
**Fecha de Información: 25 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\$760,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.<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	161,1	280,3	71,3	127,1	175,0	-	407,4
15-35	190,7	115,4	34,4	159,3	50,0	0,4	275,1
36-60	15,0	8,7	8,7	15,0	-	-	23,7
61-90	26,3	16,5	11,5	21,3	-	-	37,8
91-180	10,0	3,3	3,3	10,0	-	-	13,2
>180	3,5	0,1	0,1	3,5	-	-	3,6
<b>Total</b>	<b>406,6</b>	<b>424,2</b>	<b>129,2</b>	<b>336,2</b>	<b>225,0</b>	<b>0,4</b>	<b>760,8</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	0,0 %	3,9 %	6,6 %	4,8 %
15-35	5,5 %	2,7 %	6,5 %	5,8 %
36-60	-	7,3 %	7,7 %	7,6 %
61-90	7,5 %	7,2 %	7,6 %	7,5 %
91-180	-	7,6 %	7,4 %	7,4 %
>180	-	7,7 %	7,0 %	7,0 %
<b>Total</b>	<b>3,0 %</b>	<b>4,2 %</b>	<b>6,7 %</b>	<b>5,6 %</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**

Sectores	25 al 29 de Febrero				3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	25	42	1456	1755	31	17	1281	1607	30	24	655	742
<b>Otros***</b>	42	25	917	1043	17	31	1136	902	24	30	564	520
<b>Intragrupo</b>	0	0	551	126	0	0	99	7	0	0	50	7
<b>Total</b>	67	67	2924	2924	47	47	2516	2516	54	54	1269	1269

\* 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