

**Fecha de Publicación: 25 de Marzo de 2008**  
**Fecha de Información: 18 de Marzo 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\$1251,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,1%.<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	102,0	102,3	100,3	73,3	-	26,6	202,2
15-35	225,5	568,6	203,6	190,5	330,0	-	759,1
36-60	68,8	212,9	86,3	32,8	90,6	-	245,7
61-90	0,0	31,1	31,1	0,0	-	-	31,1
91-180	0,0	9,8	9,8	0,0	-	-	9,8
>180	0,0	3,6	3,6	0,0	-	-	3,6
<b>Total</b>	<b>396,3</b>	<b>928,2</b>	<b>434,5</b>	<b>296,6</b>	<b>420,6</b>	<b>26,6</b>	<b>1251,4</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	4,3 %	5,6 %	9,3 %	7,1 %
15-35	9,0 %	9,0 %	7,1 %	8,2 %
36-60	7,8 %	9,3 %	8,2 %	8,7 %
61-90	-	9,0 %	8,0 %	9,0 %
91-180	-	9,8 %	-	9,8 %
>180	-	10,7 %	7,3 %	10,6 %
<b>Total</b>	<b>8,3 %</b>	<b>8,3 %</b>	<b>7,7 %</b>	<b>8,1 %</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**

Sectores	17 al 21 de Marzo				24 al 28 de Marzo				31 de Mar. al 4 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	32	1610	2165	24	48	1598	1585	11	24	1149	1730
Otros***	32	8	1237	1064	48	24	924	1227	24	11	884	897
Intragrupo	0	0	489	105	0	0	319	27	0	0	643	49
<b>Total</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>3335</b>	<b>3335</b>	<b>73</b>	<b>73</b>	<b>2840</b>	<b>2840</b>	<b>35</b>	<b>35</b>	<b>2676</b>	<b>2676</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