

**Fecha de Publicación: 21 de Mayo de 2008**  
**Fecha de Información: 19 de Mayo 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\$897,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 11,1%.<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	152,0	50,4	42,4	152,0	8,0	-	202,4
15-35	210,3	500,2	199,2	163,3	262,0	8,0	671,5
36-60	12,3	0,1	0,1	12,3	-	-	12,5
61-90	0,2	0,8	0,8	0,2	-	-	1,0
91-180	7,7	1,9	1,9	7,7	-	-	9,6
>180	0,0	0,1	0,1	0,0	-	-	0,1
<b>Total</b>	<b>382,5</b>	<b>553,5</b>	<b>244,5</b>	<b>335,5</b>	<b>270,0</b>	<b>8,0</b>	<b>897,0</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	-	6,3 %	20,4 %	17,3 %
15-35	6,4 %	9,3 %	7,5 %	8,3 %
36-60	-	10,2 %	8,3 %	8,3 %
61-90	-	8,3 %	8,0 %	8,2 %
91-180	-	8,9 %	8,4 %	8,5 %
>180	-	8,7 %	-	8,7 %
<b>Total</b>	<b>6,4 %</b>	<b>8,7 %</b>	<b>13,4 %</b>	<b>11,1 %</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	19 al 23 de Mayo				26 al 30 de Mayo				2 al 6 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	14	24	1671	2228	8	52	1347	1428	46	23	873	1210
<b>Otros***</b>	24	14	1229	1405	24	8	905	1169	23	46	673	568
<b>Intragrupo</b>	0	0	779	46	28	0	370	25	0	0	288	55
<b>Total</b>	<b>38</b>	<b>38</b>	<b>3679</b>	<b>3679</b>	<b>59</b>	<b>59</b>	<b>2622</b>	<b>2622</b>	<b>69</b>	<b>69</b>	<b>1833</b>	<b>1833</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