

**Fecha de Publicación: 29 de Julio de 2008**  
**Fecha de Información: 25 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\$533,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.<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	179,2	44,6	44,6	179,2	-	-	223,8
15-35	149,2	170,5	111,5	111,1	22,0	1,0	282,7
36-60	8,3	0,8	0,8	8,3	-	-	9,1
61-90	1,0	2,8	2,8	1,0	-	-	3,8
91-180	0,7	2,6	2,6	0,7	-	-	3,2
>180	5,0	6,3	6,3	5,0	-	-	11,3
<b>Total</b>	<b>343,4</b>	<b>227,5</b>	<b>168,5</b>	<b>305,4</b>	<b>22,0</b>	<b>1,0</b>	<b>533,9</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	-	3,3 %	1,9 %	2,2 %
15-35	7,3 %	8,3 %	7,0 %	7,6 %
36-60	-	9,4 %	7,8 %	8,0 %
61-90	-	8,2 %	7,4 %	8,0 %
91-180	-	8,4 %	8,0 %	8,3 %
>180	-	7,8 %	7,8 %	7,8 %
<b>Total</b>	<b>7,3 %</b>	<b>7,0 %</b>	<b>4,0 %</b>	<b>5,2 %</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	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	98	32	2146	2586	67	15	1937	2002	62	20	1389	1474
<b>Otros***</b>	31	98	1647	1606	15	67	1296	1625	20	62	1029	1100
<b>Intragrupo</b>	0	0	590	191	0	0	466	72	0	0	258	102
<b>Total</b>	<b>130</b>	<b>130</b>	<b>4383</b>	<b>4383</b>	<b>83</b>	<b>83</b>	<b>3699</b>	<b>3699</b>	<b>82</b>	<b>82</b>	<b>2677</b>	<b>2677</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