

**Fecha de Publicación: 27 de Marzo de 2008**  
**Fecha de Información: 25 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\$898,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.<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	237,2	199,4	31,4	184,2	115,0	-	383,6
15-35	243,5	279,8	159,8	177,5	60,0	6,0	463,3
36-60	22,4	0,1	0,1	22,4	-	-	22,5
61-90	11,1	10,5	10,5	11,1	-	-	21,6
91-180	1,0	2,5	2,5	1,0	-	-	3,5
>180	0,2	3,4	3,4	0,2	-	-	3,6
<b>Total</b>	<b>515,4</b>	<b>495,8</b>	<b>207,8</b>	<b>396,4</b>	<b>175,0</b>	<b>6,0</b>	<b>898,2</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	13,0 %	23,4 %	-23,3 %	-10,7 %
15-35	10,3 %	9,7 %	9,2 %	9,6 %
36-60	-	9,1 %	8,7 %	8,7 %
61-90	-	9,3 %	9,4 %	9,4 %
91-180	-	10,3 %	8,1 %	9,7 %
>180	-	9,1 %	8,0 %	9,0 %
<b>Total</b>	<b>11,6 %</b>	<b>11,7 %</b>	<b>-5,9 %</b>	<b>1,9 %</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	24 al 28 de Marzo				31 de Mar. al 4 de Abril				7 al 11 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	93	45	1720	1728	13	24	1223	1766	14	28	967	1289
<b>Otros***</b>	44	93	946	1300	24	13	891	947	28	14	866	703
<b>Intragrupo</b>	0	0	429	67	0	0	648	49	0	0	218	59
<b>Total</b>	<b>138</b>	<b>138</b>	<b>3095</b>	<b>3095</b>	<b>37</b>	<b>37</b>	<b>2762</b>	<b>2762</b>	<b>42</b>	<b>42</b>	<b>2051</b>	<b>2051</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