

**Fecha de Publicación: 17 de Abril de 2008**  
**Fecha de Información: 15 de Abril 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\$807,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,2%.<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	182,1	151,0	89,4	130,4	11,7	1,7	283,1
15-35	173,5	253,0	118,9	85,5	76,1	30,0	368,4
36-60	52,6	92,1	60,0	20,5	21,8	21,8	134,3
61-90	5,4	2,5	2,5	5,4	-	-	7,9
91-180	8,7	6,7	0,7	2,7	-	-	9,4
>180	2,3	2,3	2,3	2,3	-	-	4,6
<b>Total</b>	<b>424,5</b>	<b>507,6</b>	<b>273,8</b>	<b>246,7</b>	<b>109,5</b>	<b>53,4</b>	<b>807,8</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	20,0 %	7,4 %	12,3 %	12,1 %
15-35	8,4 %	10,2 %	7,5 %	8,9 %
36-60	7,5 %	8,9 %	8,3 %	8,6 %
61-90	-	8,4 %	7,4 %	7,7 %
91-180	4,3 %	8,8 %	7,6 %	5,6 %
>180	-	9,2 %	7,5 %	8,4 %
<b>Total</b>	<b>12,8 %</b>	<b>9,0 %</b>	<b>10,1 %</b>	<b>10,2 %</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	14 al 18 de Abril				21 al 25 de Abril				28 de Abr. al 2 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	22	18	1710	2445	16	211	1480	1415	6	46	1306	1832
<b>Otros***</b>	18	22	1245	1420	211	16	775	1005	46	6	948	890
<b>Intragrupo</b>	0	0	940	30	0	0	221	56	0	0	534	66
<b>Total</b>	<b>40</b>	<b>40</b>	<b>3895</b>	<b>3895</b>	<b>227</b>	<b>227</b>	<b>2476</b>	<b>2476</b>	<b>52</b>	<b>52</b>	<b>2788</b>	<b>2788</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