

**Fecha de Publicación: 2 de Mayo de 2008**  
**Fecha de Información: 29 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\$1134,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,0%.<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	99,1	414,8	180,8	99,1	234,0	-	513,9
15-35	250,0	340,3	195,3	220,0	130,1	15,0	575,3
36-60	8,1	18,0	18,0	8,1	-	-	26,1
61-90	8,2	0,0	0,0	8,2	-	-	8,2
91-180	4,7	0,0	0,0	4,7	-	-	4,7
>180	2,0	3,8	3,8	2,0	-	-	5,9
<b>Total</b>	<b>372,2</b>	<b>776,9</b>	<b>397,9</b>	<b>342,2</b>	<b>364,1</b>	<b>15,0</b>	<b>1134,2</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	-	13,6 %	4,5 %	10,4 %
15-35	8,8 %	8,1 %	8,4 %	8,3 %
36-60	-	8,2 %	6,6 %	7,7 %
61-90	-	-	7,5 %	7,5 %
91-180	-	-	7,5 %	7,5 %
>180	-	8,4 %	7,6 %	8,1 %
<b>Total</b>	<b>8,8 %</b>	<b>10,6 %</b>	<b>7,2 %</b>	<b>9,0 %</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	28 de Abr. al 2 de Mayo				5 al 9 de Mayo				12 al 16 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	28	95	3069	3271	330	50	2762	2993	223	53	1910	1983
<b>Otros***</b>	47	14	1268	1351	25	165	1114	1190	27	112	804	861
<b>Intragrupo</b>	47	14	1636	1351	25	165	1496	1190	27	112	991	861
<b>Total</b>	122	122	5973	5973	380	380	5373	5373	277	277	3705	3705

\* 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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo