

**Fecha de Publicación: 28 de Mayo de 2008**  
**Fecha de Información: 23 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\$1046,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,3%.<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	163,4	389,3	73,3	163,4	316,0	-	552,7
15-35	150,8	321,8	224,8	112,8	59,0	-	434,6
36-60	14,0	0,2	0,2	14,0	-	-	14,2
61-90	0,8	0,5	0,1	0,8	0,4	-	1,3
91-180	0,5	40,1	40,1	0,5	-	-	40,5
>180	0,0	3,2	3,2	0,0	-	-	3,2
<b>Total</b>	<b>329,4</b>	<b>755,0</b>	<b>341,6</b>	<b>291,4</b>	<b>375,4</b>	<b>-</b>	<b>1046,5</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	-	7,6 %	8,5 %	8,2 %
15-35	5,4 %	9,2 %	7,8 %	8,4 %
36-60	-	8,1 %	8,4 %	8,4 %
61-90	-	9,7 %	7,4 %	7,6 %
91-180	-	8,3 %	7,8 %	8,3 %
>180	-	8,1 %	-	8,1 %
<b>Total</b>	<b>5,4 %</b>	<b>8,7 %</b>	<b>8,2 %</b>	<b>8,3 %</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>	15	21	1674	2442	18	53	1601	1892	63	24	1200	1680
<b>Otros***</b>	21	15	1243	1408	25	18	1102	1352	24	63	803	856
<b>Intragrupo</b>	0	0	979	46	28	0	566	25	0	0	588	55
<b>Total</b>	<b>36</b>	<b>36</b>	<b>3896</b>	<b>3896</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>3269</b>	<b>3269</b>	<b>86</b>	<b>86</b>	<b>2591</b>	<b>2591</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:  $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$ . Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo