

**Fecha de Publicación: 29 de Mayo de 2008**  
**Fecha de Información: 27 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\$467,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.<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	37,8	52,4	32,4	27,8	10,0	-	80,2
15-35	196,6	164,0	123,0	136,6	16,0	35,0	335,6
36-60	6,0	0,7	0,7	6,0	-	-	6,7
61-90	0,5	25,0	25,0	0,5	-	-	25,5
91-180	4,3	1,0	0,9	4,3	-	-	5,3
>180	11,1	3,0	3,0	11,1	-	-	14,1
<b>Total</b>	<b>256,4</b>	<b>245,9</b>	<b>184,9</b>	<b>186,3</b>	<b>26,0</b>	<b>35,0</b>	<b>467,3</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	9,5 %	9,0 %	6,3 %	8,0 %
15-35	9,3 %	8,6 %	7,6 %	8,2 %
36-60	-	8,7 %	8,4 %	8,4 %
61-90	-	8,4 %	7,6 %	8,4 %
91-180	8,0 %	8,6 %	7,6 %	7,8 %
>180	-	8,0 %	3,5 %	4,5 %
<b>Total</b>	<b>9,4 %</b>	<b>8,6 %</b>	<b>7,2 %</b>	<b>8,0 %</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**

Sector	26 al 30 de Mayo				2 al 6 de Junio				9 al 13 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	10	53	1618	1907	71	24	1204	1718	136	23	1018	1368
<b>Otros***</b>	25	10	1107	1359	24	71	830	860	23	136	732	723
<b>Intragrupo</b>	28	0	566	25	0	0	598	55	0	0	367	26
<b>Total</b>	<b>63</b>	<b>63</b>	<b>3290</b>	<b>3290</b>	<b>95</b>	<b>95</b>	<b>2632</b>	<b>2632</b>	<b>159</b>	<b>159</b>	<b>2118</b>	<b>2118</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