

**Fecha de Publicación: 6 de Junio de 2008**  
**Fecha de Información: 4 de Junio 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\$750,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.<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	147,9	221,3	63,3	137,9	158,0	10,0	369,2
15-35	162,6	201,5	138,8	123,6	32,7	9,0	334,1
36-60	23,8	2,3	2,3	23,8	-	-	26,1
61-90	9,6	0,6	0,6	9,6	-	-	10,2
91-180	3,3	5,6	5,5	3,2	-	-	8,8
>180	1,4	0,3	0,3	1,4	-	-	1,7
<b>Total</b>	<b>348,7</b>	<b>431,6</b>	<b>210,8</b>	<b>299,6</b>	<b>190,7</b>	<b>19,0</b>	<b>750,2</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	-	5,9 %	2,8 %	3,8 %
15-35	8,7 %	8,7 %	7,8 %	8,3 %
36-60	-	9,2 %	8,0 %	8,1 %
61-90	-	7,5 %	8,1 %	8,1 %
91-180	8,6 %	8,2 %	8,3 %	8,2 %
>180	-	9,0 %	7,7 %	8,0 %
<b>Total</b>	<b>8,7 %</b>	<b>7,9 %</b>	<b>5,5 %</b>	<b>6,6 %</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	2 al 6 de Junio				9 al 13 de Junio				16 al 20 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	73	20	1626	2114	138	25	1325	1639	100	24	1389	1759
<b>Otros***</b>	20	73	1001	1143	25	138	845	995	24	100	917	965
<b>Intragrupo</b>	0	0	753	123	0	0	525	61	0	0	509	90
<b>Total</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>3380</b>	<b>3380</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>2694</b>	<b>2694</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>2815</b>	<b>2815</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