

**Fecha de Publicación: 9 de Junio de 2008**  
**Fecha de Información: 5 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\$1427,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,7%.<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	255,2	340,9	105,9	200,2	200,0	20,0	561,2
15-35	398,3	479,4	283,2	298,3	106,1	10,0	787,6
36-60	2,3	3,8	3,8	2,3	-	-	6,1
61-90	19,2	4,3	4,3	19,2	-	-	23,5
91-180	0,3	44,0	44,0	0,3	-	-	44,4
>180	3,2	1,4	1,4	3,2	-	-	4,6
<b>Total</b>	<b>678,5</b>	<b>873,7</b>	<b>442,6</b>	<b>523,5</b>	<b>306,1</b>	<b>30,0</b>	<b>1427,3</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	-1,1 %	2,3 %	6,6 %	4,5 %
15-35	12,4 %	9,0 %	8,7 %	9,3 %
36-60	-	6,4 %	9,0 %	7,3 %
61-90	-	9,0 %	7,6 %	7,9 %
91-180	-	7,9 %	6,5 %	7,9 %
>180	-	8,7 %	7,7 %	8,0 %
<b>Total</b>	<b>8,6 %</b>	<b>7,2 %</b>	<b>7,8 %</b>	<b>7,7 %</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
Sector Financiero**	73	20	1626	2114	138	25	1538	1915	100	25	1430	1824
Otros***	20	73	1001	1143	25	138	921	1173	25	100	947	987
Intragrupo	0	0	753	123	0	0	710	81	0	0	524	90
<b>Total</b>	<b>93</b>	<b>93</b>	<b>3380</b>	<b>3380</b>	<b>163</b>	<b>163</b>	<b>3170</b>	<b>3170</b>	<b>124</b>	<b>124</b>	<b>2901</b>	<b>2901</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