

**Fecha de Publicación: 25 de Junio de 2008**  
**Fecha de Información: 23 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\$1447,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.<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	263,6	240,0	64,9	263,5	175,0	-	503,5
15-35	338,8	580,7	418,2	247,8	92,5	21,0	849,5
36-60	16,1	15,1	15,1	16,1	-	-	31,2
61-90	9,9	0,0	0,0	9,9	-	-	10,0
91-180	24,4	16,3	16,3	24,4	-	-	40,7
>180	12,1	0,0	0,0	12,1	-	-	12,1
<b>Total</b>	<b>664,9</b>	<b>852,2</b>	<b>514,6</b>	<b>573,8</b>	<b>267,5</b>	<b>21,0</b>	<b>1447,0</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	20,1 %	19,9 %	-23,4 %	-17,9 %
15-35	11,6 %	7,0 %	8,7 %	8,0 %
36-60	-	12,7 %	6,4 %	9,5 %
61-90	-	7,3 %	5,2 %	5,2 %
91-180	-	6,6 %	8,1 %	7,5 %
>180	-	9,2 %	7,3 %	7,3 %
<b>Total</b>	<b>11,6 %</b>	<b>8,0 %</b>	<b>-5,2 %</b>	<b>1,7 %</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	23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Sector Financiero**</b>	48	24	2182	2811	43	16	1290	1235	60	15	1641	1751
<b>Otros***</b>	24	48	1500	1875	16	43	783	994	15	60	1036	1261
<b>Intragrupo</b>	0	0	1032	28	0	0	268	112	0	0	447	112
<b>Total</b>	<b>71</b>	<b>71</b>	<b>4714</b>	<b>4714</b>	<b>60</b>	<b>60</b>	<b>2341</b>	<b>2341</b>	<b>75</b>	<b>75</b>	<b>3124</b>	<b>3124</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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo