

Fecha de Publicación: 4 de Enero de 2008
 Fecha de Información: 2 de Enero de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$514,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	48,9	166,2	51,2	48,9	115,0	-	215,1
15-35	132,1	169,7	139,7	102,1	-	-	271,8
36-60	1,9	7,9	7,9	1,9	-	-	9,9
61-90	0,3	0,0	0,0	0,3	-	-	0,3
91-180	0,3	0,1	0,1	0,3	-	-	0,4
>180	16,5	7,2	0,2	9,5	-	-	16,8
Total	200,0	351,2	199,2	163,0	115,0	-	514,2

* 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	-	11,9 %	2,4 %	6,4 %
15-35	6,0 %	6,2 %	5,3 %	5,7 %
36-60	-	8,0 %	6,8 %	7,0 %
61-90	-	4,6 %	4,6 %	4,6 %
91-180	-	4,7 %	3,7 %	4,0 %
>180	2,7 %	3,6 %	2,7 %	2,9 %
Total	5,4 %	7,4 %	4,5 %	5,8 %

*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	31 de Dic. al 4 de Enero				7 al 11 de Enero				14 al 18 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	11	806	1089	35	17	1082	1559	21	31	1077	1479
Otros***	11	22	604	685	17	35	950	840	31	21	1065	881
Intragrupo	0	0	374	10	0	0	380	12	0	0	229	10
Total	33	33	1784	1784	52	52	2412	2412	53	53	2370	2370

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Otros agentes sin intragrupo

¹ Datos provisionales.

² 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