

Fecha de Publicación: 9 de Enero de 2008
Fecha de Información: 4 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\$450,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	104,1	62,2	23,2	99,1	39,0	5,0	166,3
15-35	151,1	113,4	78,4	128,1	12,0	-	241,5
36-60	0,5	0,7	0,7	0,5	-	-	1,1
61-90	3,8	32,4	27,4	3,8	5,0	-	36,1
91-180	0,4	0,3	0,3	0,4	-	-	0,7
>180	0,4	4,0	4,0	0,4	-	-	4,4
Total	260,2	212,9	133,9	232,2	56,0	5,0	450,2

* 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	-	6,7 %	2,8 %	3,5 %
15-35	6,0 %	5,3 %	5,6 %	5,6 %
36-60	-	5,2 %	5,1 %	5,2 %
61-90	-	4,8 %	5,4 %	4,9 %
91-180	-	5,7 %	4,7 %	5,2 %
>180	-	6,1 %	5,1 %	6,0 %
Total	6,0 %	5,5 %	4,4 %	4,9 %

*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

Sectores	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**	21	8	808	1091	37	17	1210	1684	7	4	200	141
Otros***	8	21	607	687	17	37	996	958	4	7	119	198
Intragrupo	0	0	374	10	0	0	449	12	0	0	20	0
Total	29	29	1789	1789	54	54	2654	2654	11	11	339	339

* 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: $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo