

Fecha de Publicación: 10 de Enero de 2008
Fecha de Información: 8 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\$1058,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	237,5	409,1	133,9	237,5	275,2	-	646,7
15-35	217,0	191,7	109,7	140,0	12,0	7,0	338,7
36-60	19,2	30,3	30,3	19,2	-	-	49,5
61-90	0,0	2,1	2,1	0,0	-	-	2,1
91-180	1,6	18,7	18,7	1,6	-	-	20,4
>180	0,2	0,6	0,6	0,2	-	-	0,9
Total	475,6	652,6	295,4	398,6	287,2	7,0	1058,2

* 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	-	10,2 %	6,8 %	8,0 %
15-35	7,1 %	8,3 %	6,1 %	7,1 %
36-60	-	5,0 %	4,8 %	4,9 %
61-90	-	6,4 %	-	6,4 %
91-180	-	6,0 %	5,7 %	6,0 %
>180	-	6,5 %	8,4 %	7,0 %
Total	7,1 %	8,7 %	6,5 %	7,4 %

*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	7 al 11 de Enero				14 al 18 de Enero				21 al 25 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	18	1241	1971	92	33	1324	1628	13	31	553	605
Otros***	17	37	1017	989	33	92	1203	1083	31	13	413	433
Intragrupo	0	0	714	12	0	0	239	55	0	0	114	43
Total	54	54	2972	2972	125	125	2765	2765	44	44	1081	1081

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