

Fecha de Publicación: 11 de Enero de 2008
Fecha de Información: 9 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\$665,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 124,2 | 140,8 | 93,8 | 97,2 | 20,0 | - | 238,0 |
| 15-35 | 182,7 | 279,0 | 211,0 | 107,7 | 8,0 | 15,0 | 401,7 |
| 36-60 | 7,0 | 0,4 | 0,4 | 7,0 | - | - | 7,5 |
| 61-90 | 1,2 | 0,8 | 0,8 | 1,2 | - | - | 2,0 |
| 91-180 | 1,3 | 15,2 | 0,2 | 1,3 | 15,0 | - | 16,4 |
| >180 | 0,0 | 0,1 | 0,1 | 0,0 | - | - | 0,1 |
| Total | 316,4 | 436,3 | 306,3 | 214,4 | 43,0 | 15,0 | 665,7 |

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

*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 | 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 | 1424 | 1730 | 13 | 30 | 582 | 684 |
| Otros*** | 17 | 37 | 1017 | 989 | 33 | 92 | 1265 | 1163 | 30 | 13 | 485 | 455 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 714 | 12 | 0 | 0 | 259 | 55 | 0 | 0 | 114 | 43 |
| Total | 55 | 55 | 2972 | 2972 | 125 | 125 | 2948 | 2948 | 43 | 43 | 1182 | 1182 |

* 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