

Fecha de Publicación: 14 de Enero de 2008
Fecha de Información: 10 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\$773,7 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	129,7	149,7	45,7	86,8	104,0	42,9	279,4
15-35	145,4	289,9	185,2	128,4	87,7	-	418,3
36-60	21,5	12,1	0,1	9,5	-	-	21,5
61-90	10,8	12,6	12,6	10,8	-	-	23,4
91-180	1,0	3,2	3,2	1,0	-	-	4,2
>180	0,8	26,0	16,0	0,8	10,0	-	26,8
Total	309,3	493,4	262,7	237,4	201,7	42,9	773,7

* 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	-	3,6 %	8,9 %	7,1 %
15-35	6,3 %	7,3 %	6,1 %	6,8 %
36-60	4,4 %	5,7 %	6,0 %	5,1 %
61-90	-	6,0 %	6,1 %	6,1 %
91-180	-	5,5 %	4,9 %	5,3 %
>180	-	5,7 %	5,2 %	5,6 %
Total	5,5 %	6,5 %	7,1 %	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	94	36	1523	1870	13	30	617	701
Otros***	17	37	1017	989	36	94	1301	1219	30	13	502	490
Intragrupo	0	0	714	12	0	0	363	98	0	0	114	43
Total	55	55	2972	2972	130	130	3187	3187	43	43	1233	1233

* 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