

Fecha de Publicación: 16 de Enero de 2008
Fecha de Información: 14 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\$782,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	218,5	97,7	72,7	115,5	10,0	88,0	301,2
15-35	211,2	205,1	114,1	140,2	26,0	6,0	351,3
36-60	18,4	25,0	25,0	18,4	-	-	43,3
61-90	15,0	19,4	4,4	0,0	-	-	19,5
91-180	0,3	43,7	43,7	0,3	-	-	44,0
>180	10,0	13,5	13,5	10,0	-	-	23,5
Total	473,4	404,4	273,4	284,4	36,0	94,0	782,8

* 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	-14,4 %	-11,2 %	-0,2 %	-5,2 %
15-35	6,6 %	6,5 %	4,6 %	5,7 %
36-60	-	5,6 %	4,0 %	4,9 %
61-90	4,6 %	6,5 %	8,9 %	5,1 %
91-180	-	5,8 %	5,5 %	5,8 %
>180	-	6,0 %	5,3 %	5,7 %
Total	2,9 %	1,6 %	2,6 %	2,2 %

*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	14 al 18 de Enero				21 al 25 de Enero				28 de Ene. al 1 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	95	50	1862	2240	14	29	678	817	9	37	528	612
Otros***	50	95	1426	1450	29	14	618	533	37	9	458	457
Intragrupo	0	0	593	191	0	0	114	60	0	0	83	1
Total	145	145	3881	3881	43	43	1409	1409	46	46	1069	1069

* 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