

Fecha de Publicación: 18 de Enero de 2008
Fecha de Información: 16 de Enero de 2008¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1349,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	195,8	496,4	162,4	175,8	314,0	-	672,2
15-35	395,7	287,4	234,4	345,7	3,0	-	633,1
36-60	1,7	3,8	3,8	1,7	-	-	5,5
61-90	1,6	9,2	9,2	1,6	-	-	10,8
91-180	10,1	16,3	6,3	0,1	-	-	16,4
>180	0,0	11,5	11,5	0,0	-	-	11,6
Total	604,8	824,8	427,8	524,8	317,0	-	1349,6

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

*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**	92	50	1923	2418	15	30	926	1298	9	37	670	740
Otros***	50	92	1469	1511	30	15	785	722	37	9	556	545
Intragrupo	0	0	728	191	0	0	428	119	0	0	93	35
Total	143	143	4120	4120	45	45	2139	2139	46	46	1319	1319

* 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