

Fecha de Publicación: 21 de Enero de 2008
Fecha de Información: 17 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\$1137,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,0	242,4	82,4	120,0	160,0	-	362,4
15-35	370,6	326,6	256,6	312,6	12,0	-	639,2
36-60	0,4	4,0	4,0	0,4	-	-	4,4
61-90	9,5	6,4	6,4	9,5	-	-	15,9
91-180	11,0	66,5	66,5	11,0	-	-	77,5
>180	0,7	37,1	37,1	0,7	-	-	37,8
Total	512,1	683,0	453,0	454,1	172,0	-	1137,1

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

*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

Sectores	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	985	1537	10	37	732	743
Otros***	50	92	1469	1511	30	15	864	781	37	10	559	607
Intragrupo	0	0	728	191	0	0	588	119	0	0	93	35
Total	143	143	4120	4120	45	45	2436	2436	47	47	1384	1384

* 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