

Fecha de Publicación: 23 de Enero de 2008
Fecha de Información: 21 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\$395,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	83,7	93,2	93,2	83,7	-	-	176,9
15-35	75,7	95,5	76,5	68,7	12,0	-	164,2
36-60	14,5	0,1	0,1	14,5	-	-	14,6
61-90	6,2	1,0	1,0	6,2	-	-	7,2
91-180	15,8	4,0	0,0	11,4	-	0,4	15,8
>180	12,6	4,0	4,0	12,6	-	-	16,6
Total	208,5	197,8	174,8	197,0	12,0	0,4	395,3

* 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	-	-0,6 %	21,0 %	9,5 %
15-35	3,9 %	7,8 %	2,1 %	5,0 %
36-60	-	6,4 %	7,4 %	7,4 %
61-90	-	5,0 %	2,2 %	2,6 %
91-180	6,1 %	-	4,4 %	4,8 %
>180	-	6,4 %	6,0 %	6,1 %
Total	4,7 %	3,3 %	10,8 %	7,2 %

*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	21 al 25 de Enero				28 de Ene. al 1 de Febrero				4 al 8 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	23	30	1141	1743	11	37	775	788	26	27	845	998
Otros***	30	23	1030	937	37	11	604	650	27	26	687	647
Intragrupo	0	0	628	119	0	0	93	35	0	0	145	32
Total	53	53	2799	2799	48	48	1472	1472	52	52	1676	1676

* 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