

Fecha de Publicación: 24 de Enero de 2008
Fecha de Información: 22 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\$1093,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	136,0	461,5	145,9	124,4	304,0	-	585,9
15-35	110,8	307,5	259,5	86,8	24,0	-	394,3
36-60	11,8	18,2	18,2	11,8	-	-	30,0
61-90	29,7	2,6	2,6	29,7	-	-	32,4
91-180	36,7	5,2	5,1	36,7	-	-	41,9
>180	0,9	8,3	8,3	0,9	-	-	9,2
Total	326,1	803,2	439,6	290,5	328,0	-	1093,7

* 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	12,5 %	-1,0 %	11,3 %	5,6 %
15-35	7,4 %	9,3 %	6,2 %	8,4 %
36-60	-	10,2 %	6,9 %	8,9 %
61-90	-	4,7 %	5,9 %	5,8 %
91-180	4,2 %	5,1 %	5,0 %	5,0 %
>180	-	6,9 %	5,6 %	6,8 %
Total	9,1 %	6,3 %	8,2 %	7,1 %

*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**	21	30	1324	2140	11	37	796	838	26	27	867	1019
Otros***	30	21	1137	1120	37	11	638	669	27	26	698	659
Intragrupo	0	0	918	119	0	0	107	35	0	0	145	32
Total	51	51	3379	3379	49	49	1541	1541	52	52	1709	1709

* 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