

Fecha de Publicación: 29 de Enero de 2008
Fecha de Información: 25 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\$924,8 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	128,5	374,4	68,4	46,1	260,0	36,4	456,9
15-35	184,3	236,7	153,3	139,3	38,4	-	376,0
36-60	48,1	32,8	2,8	18,1	-	-	50,8
61-90	17,0	14,4	2,4	5,0	-	-	19,4
91-180	1,0	18,2	18,2	1,0	-	-	19,2
>180	0,0	2,3	2,3	0,0	-	-	2,3
Total	378,9	678,8	247,5	209,5	298,4	36,4	924,8

* 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	-0,7 %	2,7 %	13,3 %	4,8 %
15-35	12,7 %	8,5 %	6,9 %	8,4 %
36-60	6,7 %	6,3 %	6,8 %	6,7 %
61-90	6,2 %	7,8 %	9,1 %	7,1 %
91-180	-	8,2 %	6,6 %	8,1 %
>180	-	6,3 %	7,0 %	6,3 %
Total	6,1 %	6,8 %	8,4 %	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**	21	28	1325	2142	11	39	1004	1520	26	26	955	1118
Otros***	28	21	1139	1122	39	11	851	810	26	26	762	711
Intragrupo	0	0	918	119	0	0	547	71	0	0	145	32
Total	49	49	3382	3382	50	50	2402	2402	52	52	1861	1861

* 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