

Fecha de Publicación: 31 de Enero de 2008
Fecha de Información: 29 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\$670,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	108,4	180,4	30,4	108,4	150,0	-	288,7
15-35	106,9	191,6	161,6	91,9	15,0	-	283,5
36-60	10,9	15,6	15,6	10,9	-	-	26,5
61-90	8,9	15,4	7,1	0,6	-	-	16,0
91-180	0,9	12,2	11,5	0,2	-	-	12,4
>180	25,6	17,5	17,5	15,6	-	10,0	43,1
Total	261,5	432,7	243,7	227,5	165,0	10,0	670,3

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

*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	28 de Ene. al 1 de Febrero				4 al 8 de Febrero				11 al 15 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	39	1109	1730	27	28	1041	1153	57	39	1373	1621
Otros***	39	11	910	896	28	27	786	782	39	57	1189	1048
Intragrupo	0	0	697	91	0	0	145	37	0	0	134	27
Total	49	49	2716	2716	55	55	1972	1972	96	96	2696	2696

* 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