

Fecha de Publicación: 1 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 30 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\$536,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	134,0	113,5	103,5	134,0	10,0	-	247,5
15-35	140,0	88,3	55,0	126,0	19,3	-	214,3
36-60	0,1	11,3	11,3	0,1	-	-	11,5
61-90	1,4	11,6	11,6	1,4	-	-	13,1
91-180	0,7	16,4	16,4	0,7	-	-	17,1
>180	0,0	33,2	33,2	0,0	-	-	33,2
Total	276,3	274,4	231,1	262,3	29,3	-	536,7

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

*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**	10	36	1109	1732	29	28	1151	1222	57	40	1416	1665
Otros***	36	10	913	896	28	29	846	892	40	57	1233	1091
Intragrupo	0	0	697	91	0	0	155	37	0	0	134	27
Total	47	47	2719	2719	57	57	2151	2151	97	97	2783	2783

* 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