

Fecha de Publicación: 4 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 31 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\$900,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	228,0	126,1	126,1	135,1	-	92,9	354,1
15-35	250,9	317,0	184,4	176,2	57,9	-	493,2
36-60	11,8	11,7	1,7	1,8	-	-	13,5
61-90	8,3	16,6	10,6	2,3	-	-	18,9
91-180	0,4	14,0	14,0	0,4	-	-	14,4
>180	0,7	5,9	5,9	0,7	-	-	6,6
Total	500,2	491,2	342,6	316,6	57,9	92,9	900,7

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

*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	1113	1736	31	28	1336	1288	58	41	1456	1743
Otros***	36	10	917	899	28	31	911	985	41	58	1310	1131
Intragrupo	0	0	697	91	0	0	155	130	0	0	134	27
Total	47	47	2726	2726	59	59	2402	2402	99	99	2900	2900

* 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