

Fecha de Publicación: 5 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 1 de Febrero 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\$537,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	82,9	185,9	55,9	67,9	115,0	-	253,8
15-35	118,9	172,3	103,3	53,9	4,0	-	226,2
36-60	0,9	10,4	10,4	0,9	-	-	11,3
61-90	0,1	19,2	19,2	0,1	-	-	19,2
91-180	13,1	11,8	11,8	13,1	-	-	24,9
>180	0,0	2,0	2,0	0,0	-	-	2,0
Total	215,9	401,6	202,5	135,9	119,0	-	537,5

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

*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	29	1113	1743	31	25	1395	1451	61	41	1476	1768
Otros***	29	10	923	899	25	31	944	1029	41	61	1335	1151
Intragrupo	0	0	697	91	0	0	270	130	0	0	134	27
Total	40	40	2733	2733	56	56	2609	2609	103	103	2946	2946

* 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: $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo