

Fecha de Publicación: 7 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 5 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\$476,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,6	82,8	51,8	99,6	3,0	-	182,4
15-35	141,0	172,5	101,5	90,0	20,0	-	262,5
36-60	5,6	2,2	2,2	5,6	-	-	7,8
61-90	10,4	0,1	0,1	10,4	-	-	10,5
91-180	1,9	0,2	0,2	1,9	-	-	2,1
>180	6,4	4,6	4,6	6,4	-	-	11,0
Total	293,0	262,3	160,3	214,0	23,0	-	476,3

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

*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	4 al 8 de Febrero				11 al 15 de Febrero				18 al 22 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	36	20	1491	1538	65	42	1587	1842	37	23	1214	1351
Otros***	20	36	1019	1091	42	65	1392	1247	23	37	1017	977
Intragrupo	0	0	270	151	0	0	137	27	0	0	99	1
Total	56	56	2780	2780	107	107	3116	3116	60	60	2330	2330

* 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