

Fecha de Publicación: 8 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 6 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\$680,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	183,2	141,0	91,0	111,1	35,0	57,1	309,2
15-35	138,0	142,2	89,2	98,0	13,0	-	240,3
36-60	20,0	59,7	2,6	20,0	57,1	-	79,7
61-90	10,3	18,5	18,5	5,3	-	5,0	28,8
91-180	2,1	3,5	3,5	2,1	-	-	5,5
>180	16,2	0,8	0,8	16,2	-	-	17,0
Total	369,8	365,7	205,6	252,7	105,1	62,1	680,5

* 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	0,4 %	5,7 %	11,7 %	8,4 %
15-35	5,8 %	10,5 %	7,1 %	8,2 %
36-60	-	6,5 %	5,0 %	5,2 %
61-90	-	8,7 %	7,5 %	8,4 %
91-180	-	7,2 %	7,7 %	7,4 %
>180	-	7,0 %	8,1 %	8,1 %
Total	4,4 %	8,1 %	9,0 %	8,1 %

*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

Sectores	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	24	1517	1553	68	40	1733	1939	37	23	1249	1394
Otros***	24	36	1034	1116	39	68	1454	1336	23	37	1045	997
Intragrupo	0	0	270	151	0	0	172	84	0	0	99	1
Total	60	60	2820	2820	107	107	3359	3359	60	60	2393	2393

* 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