

Fecha de Publicación: 12 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 8 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\$620,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	110,0	78,5	53,5	81,0	-	4,1	163,5
15-35	236,9	218,4	95,4	110,9	2,0	5,0	334,3
36-60	12,5	3,1	3,1	12,5	-	-	15,6
61-90	3,8	39,2	36,1	0,6	-	-	39,8
91-180	2,3	33,8	33,8	2,3	-	-	36,1
>180	20,1	20,9	11,1	10,3	-	-	31,2
Total	385,6	393,8	232,9	217,6	2,0	9,1	620,5

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

*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	17	1508	1558	72	42	2020	2484	39	23	1362	1443
Otros***	17	36	1038	1107	42	72	1633	1521	23	39	1084	1101
Intragrupo	0	0	270	151	0	0	492	140	0	0	99	1
Total	53	53	2816	2816	114	114	4144	4144	62	62	2546	2546

* 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