

Fecha de Publicación: 27 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 25 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\$760,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,1	280,3	71,3	127,1	175,0	-	407,4
15-35	190,7	115,4	34,4	159,3	50,0	0,4	275,1
36-60	15,0	8,7	8,7	15,0	-	-	23,7
61-90	26,3	16,5	11,5	21,3	-	-	37,8
91-180	10,0	3,3	3,3	10,0	-	-	13,2
>180	3,5	0,1	0,1	3,5	-	-	3,6
Total	406,6	424,2	129,2	336,2	225,0	0,4	760,8

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

*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

Sector	25 al 29 de Febrero				3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	25	42	1456	1755	31	17	1281	1607	30	24	655	742
Otros***	42	25	917	1043	17	31	1136	902	24	30	564	520
Intragrupo	0	0	551	126	0	0	99	7	0	0	50	7
Total	67	67	2924	2924	47	47	2516	2516	54	54	1269	1269

* 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