

Fecha de Publicación: 13 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 11 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\$376,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,1	81,8	30,8	93,1	24,0	-	175,0
15-35	52,2	136,2	106,2	27,2	5,0	-	163,3
36-60	0,1	3,3	3,3	0,1	-	-	3,4
61-90	1,0	4,3	1,3	1,0	3,0	-	5,3
91-180	0,8	6,9	6,9	0,8	-	-	7,8
>180	8,8	12,7	12,7	8,8	-	-	21,6
Total	183,1	245,3	161,3	131,1	32,0	-	376,3

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

*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	11 al 15 de Febrero				18 al 22 de Febrero				25 al 29 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	82	32	2071	2544	40	23	1425	1474	16	42	941	1099
Otros***	32	82	1648	1551	23	40	1110	1159	42	16	671	689
Intragrupo	0	0	516	140	0	0	99	1	0	0	181	6
Total	114	114	4235	4235	63	63	2635	2635	58	58	1793	1793

* 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