

Fecha de Publicación: 3 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 28 de Febrero de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$968,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	147,8	291,0	86,0	147,8	205,0	-	438,9
15-35	312,9	146,5	84,6	235,9	15,9	31,0	413,4
36-60	11,1	2,1	2,1	11,1	-	-	13,2
61-90	21,1	3,2	3,2	21,1	-	-	24,3
91-180	16,2	48,8	38,8	6,2	-	-	55,0
>180	4,0	19,8	19,8	4,0	-	-	23,8
Total	513,2	511,4	234,4	426,2	220,9	31,0	968,6

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

*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**	26	34	1522	1810	45	17	1645	2014	34	26	869	815
Otros***	34	26	972	1084	17	45	1278	1087	26	34	608	705
Intragrupo	0	0	551	151	0	0	324	147	0	0	50	7
Total	60	60	3045	3045	61	61	3247	3247	60	60	1527	1527

* 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