

Fecha de Publicación: 4 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 29 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\$642,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	146,4	188,9	183,9	141,4	-	-	330,3
15-35	120,1	138,4	85,4	69,2	20,0	17,9	225,5
36-60	36,4	5,6	5,6	36,4	-	-	42,0
61-90	17,8	11,9	11,9	17,8	-	-	29,8
91-180	1,0	3,6	3,6	1,0	-	-	4,7
>180	6,4	4,2	4,2	6,4	-	-	10,6
Total	328,1	352,7	294,7	272,2	20,0	17,9	642,8

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

*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	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**	22	34	1526	1810	48	16	1753	2062	35	26	903	956
Otros***	34	22	972	1088	16	48	1327	1195	26	35	743	734
Intragrupo	0	0	551	151	0	0	324	147	0	0	50	7
Total	56	56	3048	3048	64	64	3404	3404	61	61	1697	1697

* 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