

Fecha de Publicación: 5 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 3 de Marzo 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\$750,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	152,0	88,1	88,1	57,0	-	95,0	240,1
15-35	248,6	195,3	83,3	199,6	63,0	-	394,9
36-60	32,0	8,8	8,8	32,0	-	-	40,8
61-90	10,9	7,9	7,9	10,9	-	-	18,7
91-180	11,3	2,6	2,6	11,3	-	-	13,8
>180	0,9	41,0	41,0	0,9	-	-	41,9
Total	455,7	343,5	231,5	311,7	63,0	95,0	750,2

* 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	-	26,9 %	-1,9 %	16,2 %
15-35	8,0 %	11,2 %	4,9 %	6,9 %
36-60	-	9,7 %	4,7 %	5,8 %
61-90	-	9,5 %	6,6 %	7,8 %
91-180	-	9,3 %	6,4 %	6,9 %
>180	-	8,1 %	7,0 %	8,1 %
Total	8,0 %	16,5 %	3,8 %	9,2 %

*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	3 al 7 de Marzo				10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	16	1856	2075	36	26	949	1031	4	29	1121	1647
Otros***	16	48	1340	1203	26	36	819	780	29	4	997	719
Intragrupo	0	0	324	242	0	0	50	7	0	0	248	0
Total	64	64	3520	3520	61	61	1818	1818	34	34	2366	2366

* 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