

Fecha de Publicación: 6 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 4 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\$1085,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 6,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	219,6	369,7	174,7	199,6	175,0	-	569,3
15-35	133,9	301,8	176,2	80,9	72,6	-	382,7
36-60	2,0	5,0	5,0	2,0	-	-	7,0
61-90	16,0	3,6	3,6	16,0	-	-	19,6
91-180	25,6	6,7	6,7	25,6	-	-	32,3
>180	12,0	62,4	62,4	12,0	-	-	74,4
Total	409,2	749,1	428,6	336,2	247,6	-	1085,3

* 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	12,4 %	16,2 %	-3,0 %	5,8 %
15-35	8,0 %	10,8 %	1,8 %	8,0 %
36-60	-	8,2 %	7,8 %	8,1 %
61-90	-	9,0 %	7,5 %	7,8 %
91-180	-	7,6 %	7,7 %	7,7 %
>180	-	6,6 %	9,1 %	7,0 %
Total	9,2 %	12,0 %	0,1 %	6,9 %

*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	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**	49	16	2013	2302	37	26	1001	1118	4	29	1134	1704
Otros***	16	49	1392	1359	26	37	905	832	29	4	1034	712
Intragrupo	0	0	499	242	0	0	50	7	0	0	248	0
Total	65	65	3903	3903	63	63	1956	1956	34	34	2416	2416

* 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