

Fecha de Publicación: 29 de Febrero de 2008
Fecha de Información: 27 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\$1022,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	281,0	92,4	77,4	141,0	15,0	140,0	373,3
15-35	187,2	360,4	245,7	109,2	36,7	-	469,6
36-60	7,9	19,6	19,6	7,9	-	-	27,5
61-90	11,8	13,7	13,7	11,8	-	-	25,5
91-180	63,1	55,6	55,6	63,1	-	-	118,7
>180	5,7	2,1	2,1	5,7	-	-	7,8
Total	556,7	543,8	414,1	338,7	51,7	140,0	1022,5

* 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	-	0,5 %	11,7 %	7,7 %
15-35	11,9 %	10,0 %	7,1 %	9,6 %
36-60	-	8,9 %	7,3 %	8,5 %
61-90	-	9,4 %	6,2 %	7,9 %
91-180	-	7,9 %	6,8 %	7,3 %
>180	-	7,6 %	6,6 %	6,9 %
Total	11,9 %	7,9 %	8,9 %	8,7 %

*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**	26	34	1521	1810	32	17	1606	1746	30	24	762	791
Otros***	34	26	972	1084	17	32	1216	1047	24	30	583	597
Intragrupo	0	0	551	151	0	0	119	147	0	0	50	7
Total	60	60	3044	3044	49	49	2941	2941	54	54	1395	1395

* 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