

Fecha de Publicación: 7 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 5 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\$879,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	175,1	174,1	104,1	168,1	70,0	7,0	349,2
15-35	253,7	241,8	105,3	201,5	84,2	-	443,3
36-60	7,2	0,7	0,7	7,2	-	-	7,9
61-90	12,8	42,6	42,6	12,8	-	-	55,4
91-180	3,7	12,7	12,7	3,7	-	-	16,5
>180	1,5	5,4	5,4	1,5	-	-	6,9
Total	454,1	477,4	271,0	394,8	154,2	7,0	879,2

* 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	-	13,6 %	24,2 %	19,6 %
15-35	2,6 %	7,4 %	6,0 %	5,9 %
36-60	-	13,2 %	11,1 %	11,3 %
61-90	-	13,5 %	7,8 %	12,2 %
91-180	-	8,1 %	7,3 %	7,9 %
>180	-	8,5 %	8,0 %	8,4 %
Total	2,6 %	10,8 %	13,0 %	11,3 %

*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	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**	53	17	2014	2303	35	27	1147	1288	4	30	1162	1707
Otros***	17	53	1393	1361	27	35	1005	970	30	4	1037	740
Intragrupo	0	0	499	242	0	0	120	14	0	0	248	0
Total	70	70	3906	3906	61	61	2272	2272	34	34	2447	2447

* 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