

Fecha de Publicación: 11 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 7 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\$757,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	33,6	188,8	35,8	25,6	145,0	-	214,4
15-35	199,2	231,3	159,8	151,2	38,5	15,0	397,5
36-60	67,6	3,3	3,3	67,6	-	-	70,9
61-90	12,4	0,3	0,3	12,4	-	-	12,6
91-180	23,2	23,4	23,4	23,2	-	-	46,6
>180	12,9	3,0	3,0	12,9	-	-	15,9
Total	348,8	450,1	225,6	292,8	183,5	15,0	757,9

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

*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	15	2014	2305	36	27	1369	1565	7	30	1202	1732
Otros***	15	53	1394	1361	27	36	1114	1044	30	7	1054	771
Intragrupo	0	0	499	242	0	0	280	154	0	0	248	0
Total	68	68	3907	3907	63	63	2763	2763	38	38	2503	2503

* 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