

Fecha de Publicación: 12 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 10 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\$874,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	126,1	221,0	106,0	126,1	115,0	-	347,1
15-35	190,0	280,3	219,3	158,5	34,0	4,5	443,3
36-60	11,1	19,8	17,6	11,1	2,2	-	30,9
61-90	3,8	12,0	12,0	3,8	-	-	15,8
91-180	28,2	19,6	7,6	16,2	-	-	35,8
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	-	-	1,1
Total	359,3	553,8	363,6	315,9	151,2	4,5	874,2

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

*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

Sector	10 al 14 de Marzo				17 al 21 de Marzo				24 al 28 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	37	27	1437	1738	7	30	1258	1780	14	48	1174	1095
Otros***	27	37	1172	1113	30	7	1102	827	48	14	680	938
Intragrupo	0	0	395	154	0	0	248	0	0	0	179	1
Total	64	64	3005	3005	38	38	2608	2608	62	62	2033	2033

* 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