

Fecha de Publicación: 13 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 11 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\$835,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	248,9	67,1	61,1	128,9	6,0	120,0	316,0
15-35	193,9	250,9	152,4	144,4	59,0	10,0	405,2
36-60	25,5	61,2	61,2	25,5	-	-	86,8
61-90	2,5	3,3	3,3	2,5	-	-	5,8
91-180	15,7	9,8	2,8	8,7	-	-	18,5
>180	2,9	0,0	0,0	2,9	-	-	2,9
Total	489,5	392,2	280,7	313,0	65,0	130,0	835,2

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

*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	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**	38	29	1577	1757	9	25	1350	1819	14	50	1242	1158
Otros***	29	38	1192	1133	25	9	1135	919	50	14	733	996
Intragrupo	0	0	395	274	0	0	254	0	0	0	179	1
Total	67	67	3164	3164	34	34	2738	2738	64	64	2154	2154

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo