

Fecha de Publicación: 10 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 6 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\$1071,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	232,5	113,3	89,3	83,5	15,0	140,0	336,8
15-35	212,3	372,5	285,0	161,3	54,5	18,0	551,8
36-60	33,5	0,1	0,1	33,5	-	-	33,6
61-90	41,2	30,6	15,4	41,2	15,2	-	71,8
91-180	5,7	1,2	1,2	5,7	-	-	6,9
>180	34,4	37,0	36,0	26,4	-	7,0	70,4
Total	559,6	554,8	427,1	351,6	84,7	165,0	1071,4

* 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	6,8 %	20,8 %	9,3 %	14,8 %
15-35	4,1 %	11,3 %	4,8 %	8,6 %
36-60	-	8,8 %	8,4 %	8,4 %
61-90	-	5,7 %	8,1 %	7,4 %
91-180	-	9,3 %	8,0 %	8,2 %
>180	7,2 %	9,3 %	7,7 %	8,6 %
Total	4,8 %	12,9 %	6,9 %	9,9 %

*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	1351	1384	7	30	1186	1723
Otros***	17	53	1393	1361	27	35	1086	1035	30	7	1045	755
Intragrupo	0	0	499	242	0	0	135	154	0	0	248	0
Total	70	70	3906	3906	62	62	2573	2573	38	38	2478	2478

* 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