

Fecha de Publicación: 19 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 17 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\$878,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 11,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	131,9	236,4	64,7	70,7	110,5	-	307,1
15-35	148,8	264,7	195,7	80,3	20,5	20,0	365,0
36-60	2,8	5,5	5,5	2,8	-	-	8,3
61-90	2,9	0,0	0,0	2,9	-	-	2,9
91-180	159,4	12,0	1,0	128,4	-	20,0	160,4
>180	0,2	35,0	5,0	0,2	30,0	-	35,2
Total	446,0	553,5	271,8	285,3	161,0	40,0	878,8

* 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	5,9 %	3,9 %	37,2 %	16,5 %
15-35	7,4 %	11,8 %	5,4 %	9,6 %
36-60	-	6,7 %	5,5 %	6,3 %
61-90	-	-	9,6 %	9,6 %
91-180	8,6 %	9,0 %	8,2 %	8,2 %
>180	-	8,6 %	7,8 %	8,6 %
Total	6,8 %	9,7 %	14,6 %	11,2 %

*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	17 al 21 de Marzo				24 al 28 de Marzo				31 de Mar. al 4 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	8	32	1608	2164	24	48	1523	1536	11	24	1068	1356
Otros***	32	8	1236	1063	47	24	876	1181	24	11	800	816
Intragrupo	0	0	489	105	0	0	319	1	0	0	353	49
Total	40	40	3332	3332	72	72	2717	2717	35	35	2221	2221

* 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