

Fecha de Publicación: 26 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 19 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\$440,7 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	49,0	7,2	7,2	9,0	-	40,0	56,2
15-35	115,4	102,3	78,6	105,4	13,7	-	207,7
36-60	18,1	118,3	67,3	8,1	41,0	-	126,3
61-90	0,3	22,5	22,5	0,3	-	-	22,8
91-180	0,3	24,5	22,0	0,3	2,5	-	24,8
>180	0,0	2,9	2,9	0,0	-	-	2,9
Total	182,9	277,8	200,6	122,9	57,2	40,0	440,7

* 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	-	6,0 %	14,6 %	10,9 %
15-35	9,1 %	4,8 %	5,9 %	5,6 %
36-60	9,7 %	8,8 %	10,0 %	9,0 %
61-90	-	7,9 %	9,4 %	7,9 %
91-180	-	8,8 %	8,8 %	8,8 %
>180	-	8,6 %	-	8,6 %
Total	9,4 %	7,0 %	6,8 %	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	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	1610	2165	25	49	1643	1584	12	24	1169	1732
Otros***	32	8	1236	1064	48	25	922	1233	24	12	886	916
Intragrupo	0	0	489	105	0	0	319	67	0	0	643	49
Total	40	40	3334	3334	74	74	2884	2884	37	37	2698	2698

* 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