

Fecha de Publicación: 27 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 25 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\$898,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	237,2	199,4	31,4	184,2	115,0	-	383,6
15-35	243,5	279,8	159,8	177,5	60,0	6,0	463,3
36-60	22,4	0,1	0,1	22,4	-	-	22,5
61-90	11,1	10,5	10,5	11,1	-	-	21,6
91-180	1,0	2,5	2,5	1,0	-	-	3,5
>180	0,2	3,4	3,4	0,2	-	-	3,6
Total	515,4	495,8	207,8	396,4	175,0	6,0	898,2

* 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	13,0 %	23,4 %	-23,3 %	-10,7 %
15-35	10,3 %	9,7 %	9,2 %	9,6 %
36-60	-	9,1 %	8,7 %	8,7 %
61-90	-	9,3 %	9,4 %	9,4 %
91-180	-	10,3 %	8,1 %	9,7 %
>180	-	9,1 %	8,0 %	9,0 %
Total	11,6 %	11,7 %	-5,9 %	1,9 %

*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	24 al 28 de Marzo				31 de Mar. al 4 de Abril				7 al 11 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	93	45	1720	1728	13	24	1223	1766	14	28	967	1289
Otros***	44	93	946	1300	24	13	891	947	28	14	866	703
Intragrupo	0	0	429	67	0	0	648	49	0	0	218	59
Total	138	138	3095	3095	37	37	2762	2762	42	42	2051	2051

* 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