

Fecha de Publicación: 28 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 26 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\$805,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	173,0	235,7	170,7	148,0	40,0	-	383,6
15-35	288,7	180,8	65,1	150,7	5,7	28,0	359,5
36-60	8,1	0,7	0,7	8,1	-	-	8,8
61-90	2,2	15,1	15,1	2,2	-	-	17,3
91-180	6,5	9,9	9,9	6,5	-	-	16,5
>180	15,0	10,1	5,1	10,0	-	-	20,1
Total	493,6	452,3	266,6	325,6	45,7	28,0	805,9

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

*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	1723	13	25	1386	1967	14	28	1005	1322
Otros***	44	93	941	1300	25	13	1028	1085	28	14	899	741
Intragrupo	0	0	429	67	0	0	688	49	0	0	218	59
Total	138	138	3090	3090	38	38	3102	3102	42	42	2122	2122

* 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