

Fecha de Publicación: 31 de Marzo de 2008
Fecha de Información: 27 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\$649,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	240,9	75,7	65,7	155,9	5,0	80,0	311,6
15-35	128,6	203,9	145,2	83,6	16,7	3,0	290,5
36-60	1,3	2,0	2,0	1,3	-	-	3,3
61-90	2,0	5,8	5,8	2,0	-	-	7,8
91-180	6,0	6,7	6,7	6,0	-	-	12,7
>180	22,4	1,0	1,0	22,4	-	-	23,5
Total	401,4	295,1	226,4	271,4	21,7	83,0	649,4

* 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	8,2 %	-0,8 %	11,5 %	7,9 %
15-35	9,2 %	12,6 %	9,1 %	11,0 %
36-60	-	14,8 %	10,6 %	13,3 %
61-90	-	8,8 %	8,9 %	8,9 %
91-180	-	8,9 %	8,5 %	8,7 %
>180	-	9,8 %	8,4 %	8,5 %
Total	9,1 %	8,5 %	10,4 %	9,5 %

*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**	25	42	1723	1729	81	25	1580	2007	14	28	1054	1358
Otros***	42	25	947	1303	25	81	1063	1210	28	14	930	775
Intragrupo	0	0	429	67	0	0	693	119	0	0	218	69
Total	67	67	3099	3099	106	106	3336	3336	42	42	2202	2202

* 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