

Fecha de Publicación: 1 de Abril de 2008
 Fecha de Información: 28 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\$1299,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	379,1	307,1	47,1	318,1	260,0	61,0	686,2
15-35	209,9	273,0	168,0	145,9	50,0	9,0	427,9
36-60	49,7	2,9	2,9	49,7	-	-	52,6
61-90	18,9	14,9	0,9	4,9	-	-	19,8
91-180	3,2	10,4	10,4	3,2	-	-	13,5
>180	21,0	87,9	77,9	11,0	-	-	99,0
Total	681,8	696,1	307,1	532,8	310,0	70,0	1299,0

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

*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

Sector	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	118	25	1722	2314	16	28	1252	1358
Otros***	41	25	947	1303	25	118	1110	1297	28	16	930	967
Intragrupo	0	0	429	67	0	0	953	174	0	0	218	75
Total	67	67	3099	3099	143	143	3784	3784	44	44	2401	2401

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo