

Fecha de Publicación: 2 de Abril de 2008
Fecha de Información: 31 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\$739,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,0	111,5	60,5	136,0	26,0	-	247,5
15-35	240,5	265,6	148,6	170,5	50,0	3,0	439,1
36-60	0,5	12,5	12,5	0,5	-	-	13,0
61-90	10,3	2,4	2,4	10,3	-	-	12,8
91-180	1,2	2,0	2,0	1,2	-	-	3,2
>180	2,0	24,2	22,2	0,0	-	-	24,2
Total	415,4	418,3	248,3	318,4	76,0	3,0	739,7

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

*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	31 de Mar. al 4 de Abril				7 al 11 de Abril				14 al 18 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	119	23	1805	2363	16	28	1325	1420	7	32	910	999
Otros***	23	119	1154	1375	28	16	946	1020	32	7	725	705
Intragrupo	0	0	953	174	0	0	244	75	0	0	100	30
Total	142	142	3912	3912	44	44	2515	2515	39	39	1734	1734

* 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