

Fecha de Publicación: 16 de Abril de 2008
Fecha de Información: 14 de Abril 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\$866,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	141,1	415,6	115,6	141,1	300,0	-	556,7
15-35	244,7	108,1	29,1	160,7	-	5,0	273,8
36-60	14,4	15,9	15,9	14,4	-	-	30,3
61-90	0,6	0,2	0,2	0,6	-	-	0,7
91-180	1,9	0,7	0,7	1,9	-	-	2,6
>180	2,0	0,0	0,0	2,0	-	-	2,0
Total	404,6	540,5	161,5	320,6	300,0	5,0	866,1

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

*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	14 al 18 de Abril				21 al 25 de Abril				28 de Abr. al 2 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	20	1682	2405	15	211	1350	1309	6	46	1286	1825
Otros***	20	12	1225	1402	211	15	711	917	46	6	941	869
Intragrupo	0	0	930	30	0	0	220	54	0	0	534	66
Total	32	32	3836	3836	226	226	2280	2280	52	52	2761	2761

* 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