

Fecha de Publicación: 4 de Abril de 2008
Fecha de Información: 2 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\$1014,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	71,9	257,7	57,7	51,9	180,0	-	309,5
15-35	350,8	358,0	96,1	174,8	88,9	3,0	535,8
36-60	69,3	16,3	16,3	69,3	-	-	85,6
61-90	2,9	2,0	2,0	2,9	-	-	4,9
91-180	8,2	31,6	31,6	8,2	-	-	39,7
>180	8,8	35,0	30,0	3,8	-	-	38,8
Total	511,8	700,5	233,6	310,8	268,9	3,0	1014,3

* 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	4,8 %	16,0 %	8,8 %	11,4 %
15-35	8,8 %	8,9 %	8,3 %	8,6 %
36-60	-	8,4 %	8,0 %	8,0 %
61-90	-	9,1 %	8,4 %	8,7 %
91-180	-	8,8 %	8,2 %	8,7 %
>180	8,6 %	7,9 %	8,2 %	8,0 %
Total	8,4 %	10,5 %	8,3 %	9,0 %

*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	20	1850	2405	86	33	1458	1708	7	32	1012	1033
Otros***	20	119	1196	1420	33	86	993	1093	32	7	743	792
Intragrupo	0	0	953	174	0	0	424	75	0	0	100	30
Total	139	139	3999	3999	118	118	2875	2875	39	39	1856	1856

* 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