

Fecha de Publicación: 8 de Abril de 2008
Fecha de Información: 4 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\$453,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	100,1	74,5	14,5	90,1	50,0	-	164,6
15-35	97,1	145,0	129,0	81,1	-	-	226,1
36-60	0,1	6,7	6,7	0,1	-	-	6,7
61-90	4,7	3,8	3,8	4,7	-	-	8,5
91-180	8,6	5,8	5,8	8,6	-	-	14,4
>180	32,4	1,0	1,0	12,4	-	20,0	33,4
Total	243,0	236,8	160,8	197,0	50,0	20,0	453,8

* 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	16,2 %	20,3 %	6,0 %	8,7 %
15-35	10,5 %	8,9 %	8,4 %	8,8 %
36-60	-	9,4 %	7,9 %	9,3 %
61-90	-	10,2 %	6,3 %	8,0 %
91-180	-	9,4 %	6,4 %	7,6 %
>180	-	8,9 %	8,4 %	8,4 %
Total	12,7 %	10,0 %	7,2 %	8,7 %

*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

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**	120	20	1854	2408	86	34	1657	2053	6	32	1106	1060
Otros***	20	120	1199	1424	34	86	1082	1244	32	6	770	886
Intragrupo	0	0	953	174	0	0	633	75	0	0	100	30
Total	140	140	4006	4006	120	120	3372	3372	38	38	1976	1976

* 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