

Fecha de Publicación: 9 de Abril de 2008
Fecha de Información: 7 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\$1077,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 9,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	236,0	278,9	238,9	176,0	-	20,0	474,9
15-35	354,1	243,2	144,2	269,1	26,0	12,0	524,3
36-60	26,7	1,5	1,5	26,7	-	-	28,2
61-90	2,3	1,2	1,2	2,3	-	-	3,5
91-180	0,6	13,5	13,5	0,6	-	-	14,1
>180	27,6	5,1	5,1	27,6	-	-	32,7
Total	647,3	543,5	404,5	502,3	26,0	32,0	1077,8

* 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	6,5 %	14,2 %	8,2 %	11,3 %
15-35	8,2 %	9,3 %	7,8 %	8,3 %
36-60	-	8,2 %	8,3 %	8,3 %
61-90	-	8,7 %	8,5 %	8,6 %
91-180	-	9,1 %	8,3 %	9,1 %
>180	-	9,1 %	8,5 %	8,6 %
Total	7,6 %	12,2 %	8,0 %	9,6 %

*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	7 al 11 de Abril				14 al 18 de Abril				21 al 25 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	85	34	1822	2255	9	32	1169	1137	14	70	1042	1217
Otros***	34	85	1284	1389	32	9	807	909	70	14	643	649
Intragrupo	0	0	633	95	0	0	100	30	0	0	215	34
Total	119	119	3739	3739	41	41	2075	2075	84	84	1900	1900

* 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