

Fecha de Publicación: 10 de Abril de 2008
Fecha de Información: 8 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\$1139,2 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	177,6	368,3	153,3	157,6	195,0	-	526,0
15-35	331,7	241,0	167,0	250,2	27,0	34,5	525,7
36-60	9,2	36,5	36,5	9,2	-	-	45,7
61-90	0,4	0,6	0,6	0,4	-	-	1,0
91-180	0,7	19,0	19,0	0,7	-	-	19,7
>180	5,2	21,0	16,0	0,2	-	-	21,2
Total	524,7	686,5	392,5	418,2	222,0	34,5	1139,2

* 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	12,9 %	8,5 %	10,4 %	9,7 %
15-35	5,3 %	9,3 %	7,3 %	7,8 %
36-60	-	10,3 %	8,5 %	10,0 %
61-90	-	7,9 %	7,3 %	7,7 %
91-180	-	9,6 %	7,8 %	9,5 %
>180	8,1 %	8,8 %	7,7 %	8,7 %
Total	7,6 %	9,1 %	8,5 %	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	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	1831	2287	9	32	1317	1474	14	71	1137	1247
Otros***	34	85	1315	1398	32	9	929	1037	71	14	663	734
Intragrupo	0	0	633	95	0	0	295	30	0	0	215	34
Total	119	119	3780	3780	41	41	2540	2540	85	85	2015	2015

* 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