

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