

Fecha de Publicación: 11 de Abril de 2008
Fecha de Información: 9 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\$1121,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 8,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	92,3	180,8	140,8	92,3	40,0	-	273,1
15-35	347,1	294,7	197,7	252,1	9,0	7,0	553,8
36-60	22,3	11,6	11,6	22,3	-	-	34,0
61-90	23,5	14,0	14,0	23,5	-	-	37,4
91-180	41,6	4,9	4,9	41,6	-	-	46,6
>180	55,1	146,6	121,6	30,1	-	-	176,7
Total	581,9	652,6	490,6	461,9	49,0	7,0	1121,6

* 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	-	7,0 %	14,6 %	10,0 %
15-35	8,8 %	8,4 %	7,1 %	7,8 %
36-60	-	13,3 %	7,3 %	9,4 %
61-90	-	8,7 %	6,7 %	7,5 %
91-180	-	8,8 %	7,5 %	7,6 %
>180	8,1 %	8,5 %	8,1 %	8,4 %
Total	8,6 %	8,1 %	8,7 %	8,4 %

*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**	86	34	1831	2287	9	32	1407	1636	14	71	1206	1268
Otros***	34	86	1316	1398	32	9	1052	1127	71	14	684	802
Intragrupo	0	0	633	95	0	0	335	30	0	0	215	34
Total	120	120	3781	3781	41	41	2793	2793	85	85	2105	2105

* 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