

Fecha de Publicación: 14 de Abril de 2008
Fecha de Información: 10 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\$1275,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	164,8	325,6	67,6	164,8	258,0	-	490,4
15-35	277,6	435,5	219,5	152,0	117,0	26,6	614,1
36-60	7,9	1,2	1,2	7,9	-	-	9,1
61-90	1,4	5,8	5,8	1,4	-	-	7,2
91-180	44,3	15,6	15,6	44,3	-	-	59,8
>180	67,8	34,9	26,9	59,8	-	-	94,7
Total	563,8	818,5	336,5	430,2	375,0	26,6	1275,3

* 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	-	5,5 %	6,2 %	6,0 %
15-35	6,5 %	8,8 %	8,9 %	8,3 %
36-60	-	8,3 %	5,9 %	6,2 %
61-90	-	8,3 %	5,7 %	7,8 %
91-180	-	8,5 %	7,6 %	7,8 %
>180	8,3 %	8,2 %	7,2 %	7,6 %
Total	6,6 %	8,1 %	7,4 %	7,6 %

*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**	86	29	1832	2297	9	26	1561	1951	14	71	1232	1280
Otros***	29	86	1325	1399	26	9	1111	1281	71	14	694	829
Intragrupo	0	0	633	95	0	0	590	30	0	0	218	34
Total	115	115	3791	3791	36	36	3263	3263	86	86	2144	2144

* 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