

Fecha de Publicación: 15 de Abril de 2008
Fecha de Información: 11 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\$916,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 7,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	111,2	204,7	153,1	81,2	41,6	20,0	305,9
15-35	375,3	188,2	134,2	328,3	35,0	28,0	544,5
36-60	4,5	0,6	0,6	4,5	-	-	5,1
61-90	1,4	0,4	0,4	1,4	-	-	1,8
91-180	10,2	33,8	25,8	2,2	-	-	36,0
>180	20,0	13,1	3,1	10,0	-	-	23,1
Total	522,6	440,8	317,2	427,5	76,6	48,0	916,4

* 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	6,4 %	11,7 %	2,6 %	8,5 %
15-35	7,4 %	7,2 %	6,0 %	6,4 %
36-60	-	9,0 %	8,7 %	8,8 %
61-90	-	7,6 %	5,0 %	5,6 %
91-180	4,3 %	8,7 %	7,9 %	7,7 %
>180	8,0 %	8,5 %	8,1 %	8,1 %
Total	6,8 %	9,5 %	5,5 %	7,2 %

*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	32	1832	2297	9	25	1615	2064	15	141	1284	1299
Otros***	32	86	1325	1399	25	9	1185	1335	141	15	701	851
Intragrupo	0	0	633	95	0	0	630	30	0	0	220	54
Total	118	118	3791	3791	34	34	3429	3429	156	156	2204	2204

* 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