

Fecha de Publicación: 21 de Abril de 2008
Fecha de Información: 17 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\$860,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada 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	115,5	409,9	89,9	95,5	300,0	-	505,4
15-35	109,6	186,6	99,0	73,6	51,6	-	260,2
36-60	1,3	40,5	40,5	1,3	-	-	41,8
61-90	5,8	1,0	1,0	5,8	-	-	6,8
91-180	2,7	23,2	23,2	2,7	-	-	25,9
>180	0,8	20,0	20,0	0,8	-	-	20,8
Total	235,7	681,2	273,6	179,7	351,6	-	860,9

* 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	2,0 %	11,6 %	9,4 %	9,7 %
15-35	5,7 %	8,5 %	8,0 %	7,9 %
36-60	-	8,5 %	7,0 %	8,5 %
61-90	-	8,3 %	8,0 %	8,0 %
91-180	-	8,5 %	7,5 %	8,4 %
>180	-	8,1 %	7,6 %	8,1 %
Total	4,4 %	9,5 %	8,8 %	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	14 al 18 de Abril				21 al 25 de Abril				28 de Abr. al 2 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	22	18	1732	2466	19	211	1763	2168	6	47	1360	1910
Otros***	18	22	1246	1422	211	19	946	1248	47	6	1016	933
Intragrupo	0	0	940	30	0	0	763	56	0	0	534	66
Total	39	39	3918	3918	230	230	3472	3472	52	52	2909	2909

* 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