

Fecha de Publicación: 22 de Abril de 2008
Fecha de Información: 18 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\$549,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,1	127,0	120,0	120,1	-	-	247,1
15-35	175,5	129,6	81,6	140,5	13,0	-	270,2
36-60	2,7	8,1	8,1	2,7	-	-	10,8
61-90	0,7	11,1	1,1	0,7	10,0	-	11,8
91-180	2,0	2,5	2,5	2,0	-	-	4,5
>180	2,5	2,8	2,8	2,5	-	-	5,3
Total	310,6	281,1	216,1	268,6	23,0	-	549,8

* 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	7,3 %	3,7 %	10,5 %	7,1 %
15-35	8,3 %	8,4 %	6,8 %	7,5 %
36-60	-	11,2 %	8,0 %	10,4 %
61-90	-	8,8 %	7,4 %	8,2 %
91-180	-	8,6 %	8,0 %	8,4 %
>180	-	8,7 %	2,1 %	5,6 %
Total	8,1 %	5,9 %	8,4 %	7,4 %

*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	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	2467	19	212	1849	2272	6	47	1401	1933
Otros***	18	22	1247	1422	212	19	1050	1333	47	6	1031	968
Intragrupo	0	0	940	30	0	0	763	56	0	0	534	66
Total	40	40	3919	3919	230	230	3661	3661	52	52	2966	2966

* 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: $((\text{Tasa Pactada/Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo