

Fecha de Publicación: 23 de Abril de 2008
Fecha de Información: 21 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\$725,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 12,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	141,4	210,3	0,0	111,2	180,0	-	321,4
15-35	171,0	276,4	181,4	89,0	18,0	5,0	370,3
36-60	22,9	1,6	1,6	22,9	-	-	24,5
61-90	0,4	0,0	0,0	0,4	-	-	0,4
91-180	0,2	9,0	9,0	0,2	-	-	9,2
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	335,9	497,2	192,0	223,6	198,0	5,0	725,9

* 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	33,1 %	-	15,8 %	19,5 %
15-35	10,2 %	9,6 %	7,8 %	9,3 %
36-60	-	7,8 %	7,8 %	7,8 %
61-90	-	-	7,0 %	7,0 %
91-180	-	8,1 %	7,2 %	8,1 %
>180	-	8,5 %	-	8,5 %
Total	16,7 %	9,5 %	11,8 %	12,0 %

*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	21 al 25 de Abril				28 de Abr. al 2 de Mayo				5 al 9 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	198	1935	2496	7	47	1456	1933	161	14	1264	1382
Otros***	198	19	1063	1389	47	7	1031	1023	14	161	917	890
Intragrupo	0	0	943	56	0	0	534	66	0	0	131	40
Total	217	217	3941	3941	53	53	3022	3022	176	176	2312	2312

* 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