

Fecha de Publicación: 24 de Abril de 2008
Fecha de Información: 22 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\$857,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,0	373,6	58,6	63,0	315,0	-	436,6
15-35	164,6	212,7	128,2	105,7	26,0	0,4	318,8
36-60	7,8	5,1	5,1	7,8	-	-	12,9
61-90	3,2	7,6	7,6	3,2	-	-	10,9
91-180	4,0	40,1	40,1	4,0	-	-	44,0
>180	33,4	4,2	1,2	30,4	-	-	34,6
Total	276,0	643,3	240,8	214,1	341,0	0,4	857,8

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

*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

Sector	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	1942	2848	7	48	1509	1947	161	14	1306	1416
Otros***	198	19	1100	1397	48	7	1045	1075	14	161	929	909
Intragrupo	0	0	1258	56	0	0	534	66	0	0	131	40
Total	217	217	4300	4300	55	55	3088	3088	176	176	2365	2365

* 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