

Fecha de Publicación: 28 de Abril de 2008
Fecha de Información: 24 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\$767,4 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	83,7	256,1	56,1	83,7	200,0	-	339,7
15-35	118,7	285,6	124,3	97,2	139,8	-	382,8
36-60	3,1	0,0	0,0	3,1	-	-	3,1
61-90	21,3	0,5	0,5	21,3	-	-	21,8
91-180	1,5	4,0	4,0	1,5	-	-	5,6
>180	9,4	5,0	5,0	9,4	-	-	14,4
Total	237,6	551,3	190,0	216,1	339,8	-	767,4

* 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	-1,9 %	7,5 %	5,1 %	6,1 %
15-35	8,4 %	8,3 %	7,9 %	8,2 %
36-60	-	9,2 %	7,5 %	7,5 %
61-90	-	9,3 %	7,3 %	7,4 %
91-180	-	8,2 %	7,3 %	7,9 %
>180	-	7,9 %	7,1 %	7,4 %
Total	8,4 %	8,1 %	6,7 %	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	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**	18	193	1953	2854	7	46	1906	2290	163	15	1434	1454
Otros***	193	18	1106	1407	46	7	1185	1312	15	163	951	1022
Intragrupo	0	0	1258	56	0	0	737	226	0	0	131	40
Total	211	211	4317	4317	52	52	3828	3828	177	177	2516	2516

* 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