

Fecha de Publicación: 29 de Abril de 2008
Fecha de Información: 25 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\$687,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,2	286,4	76,4	67,2	200,0	-	353,6
15-35	170,4	136,4	62,9	146,4	52,5	3,0	285,8
36-60	26,5	0,4	0,4	26,5	-	-	26,9
61-90	1,9	0,3	0,3	1,9	-	-	2,2
91-180	6,1	7,7	7,7	6,1	-	-	13,8
>180	4,5	0,3	0,3	4,5	-	-	4,8
Total	286,6	431,5	148,0	252,6	252,5	3,0	687,1

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

*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	1948	2854	13	46	1914	2522	163	25	1496	1497
Otros***	193	18	1106	1402	46	13	1218	1321	25	163	984	1075
Intragrupo	0	0	1258	56	0	0	937	226	0	0	131	40
Total	211	211	4312	4312	59	59	4069	4069	187	187	2611	2611

* 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