

Fecha de Publicación: 18 de Abril de 2008
Fecha de Información: 16 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\$1030,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	241,6	412,1	120,1	191,6	242,0	-	603,7
15-35	120,4	316,8	106,7	58,7	161,1	12,7	388,1
36-60	3,0	0,3	0,3	3,0	-	-	3,3
61-90	24,8	1,5	1,5	24,8	-	-	26,3
91-180	2,5	0,2	0,2	2,5	-	-	2,7
>180	3,6	3,5	3,0	3,1	-	-	6,6
Total	396,0	734,3	231,7	283,8	403,1	12,7	1030,8

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

*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	1722	2455	17	211	1696	1797	6	46	1320	1864
Otros***	18	22	1246	1422	211	17	875	1181	46	6	980	904
Intragrupo	0	0	940	30	0	0	463	56	0	0	534	66
Total	40	40	3907	3907	228	228	3034	3034	52	52	2834	2834

* 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