

Fecha de Publicación: 25 de Abril de 2008
Fecha de Información: 23 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\$1209,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	397,5	119,7	101,7	222,5	3,0	160,0	502,2
15-35	237,4	427,9	324,9	219,4	84,9	-	647,2
36-60	2,6	30,6	30,6	2,6	-	-	33,1
61-90	0,8	1,6	1,6	0,8	-	-	2,4
91-180	17,3	0,9	0,9	17,3	-	-	18,2
>180	5,0	1,7	1,7	5,0	-	-	6,7
Total	660,5	582,3	461,4	467,5	87,9	160,0	1209,9

* 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	5,4 %	12,1 %	15,3 %	13,9 %
15-35	8,9 %	9,0 %	6,9 %	8,2 %
36-60	-	7,7 %	8,6 %	7,7 %
61-90	-	9,8 %	7,1 %	8,9 %
91-180	-	8,8 %	7,5 %	7,6 %
>180	-	8,4 %	7,7 %	7,9 %
Total	7,3 %	9,6 %	10,9 %	10,2 %

*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	193	1942	2854	7	46	1844	2037	162	15	1408	1447
Otros***	193	19	1106	1397	46	7	1133	1250	15	162	944	997
Intragrupo	0	0	1258	56	0	0	537	226	0	0	131	40
Total	212	212	4307	4307	53	53	3513	3513	177	177	2484	2484

* 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