

Fecha de Publicación: 30 de Abril de 2008
Fecha de Información: 28 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\$581,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,5	53,6	53,1	93,0	-	68,0	214,5
15-35	198,7	155,7	104,2	161,2	18,0	4,0	320,9
36-60	14,9	0,1	0,1	14,9	-	-	15,0
61-90	0,2	4,0	4,0	0,2	-	-	4,2
91-180	0,5	5,2	5,2	0,5	-	-	5,6
>180	0,1	20,8	20,8	0,1	-	-	20,9
Total	375,8	239,4	187,4	269,8	18,0	72,0	581,2

* 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	6,3 %	17,8 %	8,6 %	11,9 %
15-35	8,7 %	9,2 %	7,8 %	8,4 %
36-60	-	8,7 %	7,8 %	7,8 %
61-90	-	8,8 %	6,8 %	8,7 %
91-180	-	8,6 %	7,3 %	8,5 %
>180	-	8,3 %	8,2 %	8,3 %
Total	8,6 %	11,5 %	8,1 %	9,4 %

*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	28 de Abr. al 2 de Mayo				5 al 9 de Mayo				12 al 16 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	47	2004	2574	163	25	1550	1499	110	27	1106	1279
Otros***	47	14	1270	1351	25	163	986	1120	27	110	740	791
Intragrupo	0	0	937	286	0	0	131	48	0	0	351	127
Total	60	60	4211	4211	187	187	2667	2667	137	137	2197	2197

* 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