

Fecha de Publicación: 6 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 30 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\$1040,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,6	230,1	58,1	76,0	170,0	16,7	322,8
15-35	307,5	362,4	223,0	208,5	78,4	38,0	608,9
36-60	21,1	19,7	3,2	21,1	16,5	-	40,9
61-90	2,0	4,6	4,6	2,0	-	-	6,6
91-180	11,2	15,0	15,0	11,2	-	-	26,2
>180	0,0	35,0	1,0	0,0	34,0	-	35,0
Total	436,5	666,8	304,8	318,9	299,0	54,7	1040,3

* 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	8,6 %	10,4 %	9,8 %	10,1 %
15-35	8,0 %	8,2 %	8,5 %	8,3 %
36-60	-	11,4 %	6,9 %	7,5 %
61-90	-	8,9 %	9,2 %	9,0 %
91-180	-	8,1 %	7,3 %	7,8 %
>180	-	8,8 %	-	8,8 %
Total	8,1 %	8,6 %	8,7 %	8,6 %

*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**	8	45	2012	2575	166	25	1694	2071	115	28	1212	1380
Otros***	45	8	1270	1359	25	166	1154	1247	28	115	839	896
Intragrupo	0	0	937	286	0	0	535	64	0	0	351	127
Total	54	54	4220	4220	191	191	3383	3383	143	143	2402	2402

* 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