

Fecha de Publicación: 7 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 2 de Mayo de 2008¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$441,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	88,2	67,1	67,1	88,2	-	-	155,4
15-35	90,7	190,6	119,3	57,7	41,3	3,0	251,3
36-60	5,5	0,8	0,8	5,5	-	-	6,2
61-90	0,6	3,8	3,8	0,6	-	-	4,4
91-180	12,4	5,3	5,3	12,4	-	-	17,7
>180	0,4	6,3	6,3	0,4	-	-	6,7
Total	197,7	274,0	202,7	164,7	41,3	3,0	441,7

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

*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	2011	2571	166	24	1746	2117	116	28	1248	1401
Otros***	45	8	1267	1357	24	166	1200	1299	28	116	860	931
Intragrupo	0	0	937	286	0	0	535	64	0	0	351	127
Total	54	54	4215	4215	190	190	3481	3481	143	143	2460	2460

* 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