

Fecha de Publicación: 8 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 6 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\$969,4 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	171,3	338,1	187,6	150,8	130,0	-	488,9
15-35	144,5	274,9	151,9	114,5	97,0	4,0	393,4
36-60	4,4	22,3	22,3	4,4	-	-	26,6
61-90	30,0	0,6	0,6	30,0	-	-	30,6
91-180	2,5	11,0	11,0	2,5	-	-	13,5
>180	11,4	5,0	5,0	11,4	-	-	16,4
Total	364,1	651,8	378,3	313,6	227,0	4,0	969,4

* 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	39,4 %	8,8 %	5,9 %	9,4 %
15-35	10,1 %	8,4 %	7,1 %	8,1 %
36-60	-	7,9 %	6,3 %	7,6 %
61-90	-	9,8 %	6,9 %	6,9 %
91-180	-	8,3 %	7,7 %	8,2 %
>180	-	8,2 %	8,0 %	8,1 %
Total	23,0 %	8,6 %	6,6 %	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	5 al 9 de Mayo				12 al 16 de Mayo				19 al 23 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	168	24	1793	2280	117	27	1326	1536	6	22	1085	1394
Otros***	24	168	1233	1346	27	117	975	990	22	6	950	843
Intragrupo	0	0	665	64	0	0	351	127	0	0	236	34
Total	192	192	3691	3691	144	144	2653	2653	28	28	2271	2271

* 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