

Fecha de Publicación: 9 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 7 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\$785,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	96,4	229,5	99,5	96,4	130,0	-	325,9
15-35	249,9	158,4	48,4	173,9	45,0	11,0	343,3
36-60	19,8	2,6	2,6	19,8	-	-	22,4
61-90	24,0	65,5	45,5	4,0	-	-	69,5
91-180	13,5	1,3	1,3	13,5	-	-	14,8
>180	8,6	0,5	0,5	8,6	-	-	9,1
Total	412,3	457,8	197,8	316,3	175,0	11,0	785,0

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

*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	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	1789	2302	117	31	1387	1744	7	22	1138	1413
Otros***	24	168	1254	1342	31	117	1053	1051	22	7	969	896
Intragrupo	0	0	665	64	0	0	481	127	0	0	236	34
Total	192	192	3708	3708	148	148	2922	2922	28	28	2342	2342

* 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