

Fecha de Publicación: 13 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 09 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\$860,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,1	296,1	71,1	84,1	220,0	-	380,2
15-35	269,8	223,1	130,7	198,4	23,0	2,0	423,4
36-60	6,7	0,7	0,7	6,7	-	-	7,5
61-90	8,7	3,2	3,2	8,7	-	-	11,9
91-180	3,5	6,6	6,6	3,5	-	-	10,1
>180	26,7	0,1	0,1	26,7	-	-	26,8
Total	404,6	529,8	212,4	328,2	243,0	2,0	860,0

* 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	13,4 %	10,8 %	8,8 %	9,9 %
15-35	7,4 %	7,2 %	7,9 %	7,6 %
36-60	-	8,4 %	7,2 %	7,4 %
61-90	-	2,2 %	6,3 %	5,2 %
91-180	-	8,3 %	7,6 %	8,0 %
>180	-	8,9 %	7,9 %	7,9 %
Total	7,8 %	8,4 %	8,1 %	8,2 %

*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	121	31	1575	2106	7	23	1215	1489
Otros***	24	168	1254	1342	31	121	1175	1188	23	7	1020	968
Intragrupo	0	0	665	64	0	0	721	177	0	0	256	34
Total	192	192	3708	3708	152	152	3471	3471	30	30	2491	2491

* 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