

Fecha de Publicación: 10 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 8 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\$964,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 156,7 | 133,8 | 93,8 | 106,7 | 40,0 | 50,0 | 290,5 |
| 15-35 | 238,0 | 406,8 | 272,8 | 152,3 | 63,0 | 14,7 | 573,8 |
| 36-60 | 2,6 | 1,3 | 1,3 | 2,6 | - | - | 4,0 |
| 61-90 | 10,3 | 0,1 | 0,1 | 10,3 | - | - | 10,5 |
| 91-180 | 6,4 | 11,6 | 11,6 | 6,4 | - | - | 18,0 |
| >180 | 41,6 | 26,0 | 26,0 | 41,6 | - | - | 67,6 |
| Total | 455,6 | 579,7 | 405,7 | 319,9 | 103,0 | 64,7 | 964,3 |

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

*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 | 119 | 31 | 1528 | 1845 | 7 | 23 | 1174 | 1453 |
| Otros*** | 24 | 168 | 1254 | 1342 | 31 | 119 | 1134 | 1142 | 23 | 7 | 989 | 933 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 665 | 64 | 0 | 0 | 501 | 177 | 0 | 0 | 256 | 34 |
| Total | 191 | 191 | 3708 | 3708 | 150 | 150 | 3164 | 3164 | 30 | 30 | 2420 | 2420 |

* 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