

Fecha de Publicación: 15 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 13 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\$680,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	94,2	45,7	45,7	82,2	-	12,0	139,9
15-35	212,8	296,2	141,3	122,3	66,4	2,0	420,5
36-60	6,5	11,0	11,0	6,5	-	-	17,4
61-90	31,4	0,1	0,1	31,4	-	-	31,5
91-180	1,7	39,5	23,6	1,7	15,9	-	41,2
>180	21,5	18,0	8,0	11,5	-	-	29,5
Total	368,0	410,5	229,7	255,5	82,3	14,0	680,0

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

*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	12 al 16 de Mayo				19 al 23 de Mayo				26 al 30 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	123	69	1665	2251	9	23	1289	1532	8	52	1108	1263
Otros***	69	123	1213	1268	23	9	1063	1030	24	8	800	937
Intragrupo	0	0	828	187	0	0	256	46	28	0	317	25
Total	192	192	3706	3706	33	33	2608	2608	59	59	2225	2225

* 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