

Fecha de Publicación: 16 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 14 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\$1079,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|----------|---------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 149,8 | 285,8 | 72,8 | 149,8 | 213,0 | - | 435,6 |
| 15-35 | 270,5 | 356,1 | 198,0 | 220,5 | 108,0 | - | 576,5 |
| 36-60 | 14,8 | 0,0 | 0,0 | 14,8 | - | - | 14,8 |
| 61-90 | 10,9 | 3,3 | 3,3 | 10,9 | - | - | 14,2 |
| 91-180 | 8,1 | 0,7 | 0,7 | 8,1 | - | - | 8,8 |
| >180 | 29,2 | 10,0 | 0,0 | 19,2 | - | - | 29,2 |
| Total | 483,3 | 655,8 | 274,8 | 423,3 | 321,0 | - | 1079,1 |

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

*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 | 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 | 11 | 23 | 1383 | 1818 | 8 | 52 | 1190 | 1263 |
| Otros*** | 69 | 123 | 1213 | 1268 | 23 | 11 | 1136 | 1124 | 24 | 8 | 800 | 1019 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 828 | 187 | 0 | 0 | 469 | 46 | 28 | 0 | 317 | 25 |
| Total | 192 | 192 | 3706 | 3706 | 34 | 34 | 2988 | 2988 | 59 | 59 | 2306 | 2306 |

* 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