

Fecha de Publicación: 19 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 15 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\$1134,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	170,8	300,6	73,6	156,8	213,0	-	457,3
15-35	210,7	463,6	179,1	109,7	196,5	13,0	586,4
36-60	35,9	0,0	0,0	35,9	-	-	35,9
61-90	6,9	0,0	0,0	6,9	-	-	6,9
91-180	8,4	0,7	0,7	8,4	-	-	9,1
>180	18,0	20,5	20,5	18,0	-	-	38,5
Total	450,7	785,4	273,9	335,7	409,5	13,0	1134,1

* 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	15,1 %	9,9 %	7,6 %	8,7 %
15-35	7,2 %	9,8 %	7,4 %	8,5 %
36-60	-	-	6,3 %	6,3 %
61-90	-	7,9 %	7,5 %	7,5 %
91-180	-	12,0 %	7,4 %	7,8 %
>180	-	8,5 %	7,3 %	8,0 %
Total	8,3 %	9,8 %	7,4 %	8,4 %

*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

Sector	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	2250	12	23	1474	2088	8	52	1270	1360
Otros***	69	123	1212	1269	23	12	1186	1208	24	8	850	1092
Intragrupo	0	0	828	187	0	0	682	46	28	0	357	25
Total	192	192	3706	3706	35	35	3341	3341	60	60	2477	2477

* 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