

Fecha de Publicación: 20 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 16 de Mayo de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$563,0 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	116,0	159,6	57,6	116,0	102,0	-	275,6
15-35	120,6	110,7	63,7	98,6	30,0	5,0	214,2
36-60	1,3	3,1	3,1	1,3	-	-	4,4
61-90	5,9	13,5	13,5	5,9	-	-	19,4
91-180	2,0	20,8	20,8	2,0	-	-	22,7
>180	11,0	25,7	14,6	1,0	1,1	-	26,7
Total	256,7	333,2	173,2	224,7	133,1	5,0	563,0

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

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	1666	2255	13	24	1565	2208	7	52	1295	1396
Otros***	69	123	1217	1269	24	13	1217	1299	24	7	873	1117
Intragrupo	0	0	828	187	0	0	771	46	28	0	370	25
Total	192	192	3711	3711	37	37	3552	3552	59	59	2537	2537

* 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