

Fecha de Publicación: 27 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 22 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\$634,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,9	134,2	74,2	63,9	60,0	-	198,2
15-35	214,7	214,4	119,9	176,1	69,8	14,0	404,4
36-60	7,4	0,8	0,8	7,4	-	-	8,2
61-90	0,4	0,8	0,8	0,4	-	-	1,2
91-180	18,0	2,1	2,1	3,0	-	15,0	20,0
>180	2,1	0,1	0,1	1,7	-	0,4	2,2
Total	306,6	352,3	197,9	252,5	129,8	29,4	634,2

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

*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	19 al 23 de Mayo				26 al 30 de Mayo				2 al 6 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	23	1675	2440	19	52	1555	1710	54	24	1090	1473
Otros***	23	15	1241	1409	24	19	1037	1307	24	54	796	745
Intragrupo	0	0	979	46	28	0	450	25	0	0	388	55
Total	38	38	3895	3895	71	71	3042	3042	78	78	2273	2273

* 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