

Fecha de Publicación: 30 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 28 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\$1204,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	283,5	117,0	52,0	205,5	10,0	23,0	345,5
15-35	290,4	590,7	286,9	152,4	168,8	3,0	746,2
36-60	15,1	13,7	13,7	15,1	-	-	28,8
61-90	1,7	2,0	2,0	1,7	-	-	3,7
91-180	48,7	17,2	2,2	33,7	-	-	50,9
>180	29,4	0,0	0,0	29,4	-	-	29,4
Total	668,9	740,5	356,7	437,9	178,8	26,0	1204,4

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

*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	26 al 30 de Mayo				2 al 6 de Junio				9 al 13 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	56	1618	1907	81	20	1438	1835	139	23	1070	1368
Otros***	28	10	1108	1359	20	81	882	1015	23	139	732	775
Intragrupo	28	0	566	25	0	0	608	78	0	0	367	26
Total	66	66	3291	3291	101	101	2928	2928	161	161	2170	2170

* 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