

Fecha de Publicación: 3 de Junio de 2008
Fecha de Información: 29 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\$1206,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	150,1	198,1	103,1	120,0	95,0	30,0	348,2
15-35	380,2	275,9	153,0	277,1	69,8	50,0	603,0
36-60	16,9	7,1	7,1	16,9	-	-	24,0
61-90	3,0	16,4	16,4	3,0	-	-	19,4
91-180	24,2	192,4	148,4	0,2	20,0	-	192,5
>180	0,1	19,1	19,1	0,1	-	-	19,2
Total	574,4	708,9	447,0	417,3	184,8	80,0	1206,2

* 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	4,2 %	12,2 %	16,2 %	14,3 %
15-35	8,6 %	8,6 %	9,3 %	9,0 %
36-60	-	8,2 %	8,1 %	8,2 %
61-90	-	8,2 %	8,3 %	8,2 %
91-180	7,8 %	9,2 %	7,7 %	9,0 %
>180	-	8,6 %	7,7 %	8,6 %
Total	8,4 %	9,6 %	11,2 %	10,2 %

*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	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	55	1618	1907	81	22	1532	2022	139	23	1129	1382
Otros***	27	10	1108	1359	22	81	974	1099	23	139	746	814
Intragrupo	28	0	566	25	0	0	703	88	0	0	367	46
Total	65	65	3292	3292	103	103	3209	3209	162	162	2242	2242

* 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: $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo