

Fecha de Publicación: 4 de Junio de 2008
Fecha de Información: 30 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\$852,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	77,9	126,3	76,3	77,9	50,0	-	204,2
15-35	310,7	255,1	201,1	262,7	13,0	7,0	524,8
36-60	36,1	15,5	15,5	36,1	-	-	51,6
61-90	3,1	23,3	23,3	3,1	-	-	26,4
91-180	8,3	40,3	35,3	3,3	-	-	43,6
>180	0,3	1,5	1,5	0,3	-	-	1,8
Total	436,3	462,1	353,1	383,3	63,0	7,0	852,4

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

*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	54	1614	1971	82	22	1574	2089	138	24	1176	1441
Otros***	26	10	1108	1356	22	81	991	1130	24	138	805	861
Intragrupo	28	0	628	25	0	0	753	99	0	0	367	46
Total	64	64	3351	3351	103	103	3317	3317	162	162	2348	2348

* 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