

Fecha de Publicación: 14 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 12 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\$742,6 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	80,5	183,0	76,0	70,5	107,0	10,0	263,6
15-35	224,2	207,4	116,3	193,2	75,1	15,0	415,6
36-60	22,5	15,1	15,1	22,5	-	-	37,6
61-90	1,7	3,0	3,0	1,7	-	-	4,8
91-180	4,5	10,1	10,1	4,5	-	-	14,6
>180	6,3	0,2	0,2	6,3	-	-	6,5
Total	339,7	418,8	220,7	298,7	182,1	25,0	742,6

* 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	-	8,1 %	8,6 %	8,3 %
15-35	7,0 %	5,1 %	6,7 %	6,1 %
36-60	-	9,2 %	8,0 %	8,5 %
61-90	-	6,8 %	7,5 %	7,1 %
91-180	-	8,6 %	7,3 %	8,2 %
>180	-	10,1 %	7,1 %	7,2 %
Total	7,0 %	6,6 %	7,3 %	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

Sectores	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	47	1625	2240	7	23	1243	1521	8	54	1041	1180
Otros***	47	123	1203	1228	23	7	1052	996	26	8	753	906
Intragrupo	0	0	828	187	0	0	256	34	28	0	317	25
Total	170	170	3656	3656	30	30	2551	2551	62	62	2110	2110

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