

Fecha de Publicación: 22 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 20 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\$992,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,3	339,1	98,6	79,8	200,0	-	418,8
15-35	209,2	301,4	191,4	135,2	36,0	-	436,5
36-60	4,2	0,1	0,1	4,2	-	-	4,2
61-90	2,1	0,5	0,5	2,1	-	-	2,6
91-180	108,3	6,1	1,1	93,3	-	10,0	109,5
>180	15,6	5,6	5,6	15,6	-	-	21,2
Total	459,7	652,7	297,2	330,2	236,0	10,0	992,9

* 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	13,6 %	10,2 %	8,0 %	10,0 %
15-35	9,8 %	8,2 %	8,2 %	8,5 %
36-60	-	8,7 %	8,2 %	8,2 %
61-90	-	9,1 %	7,6 %	7,9 %
91-180	8,4 %	8,7 %	8,1 %	8,1 %
>180	-	8,6 %	8,0 %	8,2 %
Total	11,0 %	8,9 %	8,1 %	8,9 %

*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**	14	22	1679	2441	10	52	1457	1525	46	23	939	1306
Otros***	22	14	1242	1413	24	10	962	1238	23	46	728	595
Intragrupo	0	0	979	46	28	0	370	25	0	0	288	55
Total	36	36	3900	3900	62	62	2788	2788	69	69	1955	1955

* 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