

Fecha de Publicación: 23 de Mayo de 2008
Fecha de Información: 21 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\$631,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 122,0 | 210,9 | 60,9 | 92,0 | 120,0 | - | 302,9 |
| 15-35 | 195,7 | 151,2 | 40,2 | 148,7 | 68,0 | 4,0 | 303,9 |
| 36-60 | 7,7 | 0,3 | 0,3 | 7,7 | - | - | 7,9 |
| 61-90 | 2,4 | 3,5 | 3,5 | 2,4 | - | - | 6,0 |
| 91-180 | 1,5 | 3,4 | 3,4 | 1,5 | - | - | 4,9 |
| >180 | 2,0 | 5,3 | 3,3 | 0,0 | - | - | 5,3 |
| Total | 331,3 | 374,7 | 111,7 | 252,3 | 188,0 | 4,0 | 631,0 |

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

*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 | 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 | 1675 | 2441 | 12 | 52 | 1518 | 1602 | 46 | 23 | 1075 | 1440 |
| Otros*** | 22 | 14 | 1242 | 1409 | 24 | 12 | 989 | 1269 | 23 | 46 | 762 | 730 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 979 | 46 | 28 | 0 | 390 | 25 | 0 | 0 | 388 | 55 |
| Total | 36 | 36 | 3895 | 3895 | 63 | 63 | 2896 | 2896 | 69 | 69 | 2225 | 2225 |

* 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