

Fecha de Publicación: 5 de Junio de 2008
Fecha de Información: 3 de Junio 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\$597,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	101,6	40,2	20,2	41,6	-	40,0	121,8
15-35	219,7	141,9	83,2	192,7	36,7	5,0	339,6
36-60	3,9	97,4	97,4	3,9	-	-	101,3
61-90	0,3	3,3	3,3	0,3	-	-	3,6
91-180	5,7	9,3	9,3	5,7	-	-	15,0
>180	3,6	12,2	12,2	3,6	-	-	15,8
Total	334,7	304,4	225,7	247,7	36,7	45,0	597,1

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

*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	2 al 6 de Junio				9 al 13 de Junio				16 al 20 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	73	21	1625	2114	138	24	1186	1450	100	24	1373	1715
Otros***	21	73	1001	1142	24	138	814	866	24	100	873	949
Intragrupo	0	0	753	123	0	0	367	51	0	0	509	90
Total	94	94	3379	3379	163	163	2367	2367	124	124	2754	2754

* 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