

Fecha de Publicación: 6 de Junio de 2008
Fecha de Información: 4 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\$750,2 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	147,9	221,3	63,3	137,9	158,0	10,0	369,2
15-35	162,6	201,5	138,8	123,6	32,7	9,0	334,1
36-60	23,8	2,3	2,3	23,8	-	-	26,1
61-90	9,6	0,6	0,6	9,6	-	-	10,2
91-180	3,3	5,6	5,5	3,2	-	-	8,8
>180	1,4	0,3	0,3	1,4	-	-	1,7
Total	348,7	431,6	210,8	299,6	190,7	19,0	750,2

* 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	-	5,9 %	2,8 %	3,8 %
15-35	8,7 %	8,7 %	7,8 %	8,3 %
36-60	-	9,2 %	8,0 %	8,1 %
61-90	-	7,5 %	8,1 %	8,1 %
91-180	8,6 %	8,2 %	8,3 %	8,2 %
>180	-	9,0 %	7,7 %	8,0 %
Total	8,7 %	7,9 %	5,5 %	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	20	1626	2114	138	25	1325	1639	100	24	1389	1759
Otros***	20	73	1001	1143	25	138	845	995	24	100	917	965
Intragrupo	0	0	753	123	0	0	525	61	0	0	509	90
Total	93	93	3380	3380	163	163	2694	2694	124	124	2815	2815

* 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