

Fecha de Publicación: 10 de Junio de 2008
Fecha de Información: 6 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\$895,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	184,9	135,7	67,7	128,9	36,0	24,0	288,6
15-35	338,1	259,6	155,6	248,1	61,0	47,0	554,6
36-60	4,7	3,3	3,3	4,7	-	-	8,0
61-90	1,6	22,7	2,7	1,6	20,0	-	24,3
91-180	10,9	12,6	7,6	5,9	-	-	18,5
>180	0,0	1,2	1,2	0,0	-	-	1,2
Total	540,2	435,0	238,0	389,2	117,0	71,0	895,2

* 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	0,7 %	5,0 %	5,5 %	4,7 %
15-35	7,2 %	10,9 %	8,6 %	9,2 %
36-60	-	8,7 %	7,6 %	8,1 %
61-90	-	8,7 %	6,2 %	7,8 %
91-180	8,5 %	8,3 %	7,0 %	7,9 %
>180	-	8,4 %	-	8,4 %
Total	4,7 %	9,1 %	7,5 %	7,7 %

*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	1621	2115	139	23	1662	2013	110	31	1483	1859
Otros***	20	73	1002	1138	23	139	983	1273	31	110	950	1007
Intragrupo	0	0	753	123	0	0	746	105	0	0	524	90
Total	93	93	3375	3375	162	162	3391	3391	140	140	2956	2956

* 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