

Fecha de Publicación: 11 de Junio de 2008
Fecha de Información: 9 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\$839,7 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	160,0	258,2	69,2	125,0	154,0	-	383,1
15-35	240,0	161,1	77,1	176,0	37,0	17,0	354,1
36-60	29,3	11,7	11,7	29,3	-	-	41,0
61-90	4,5	1,8	1,8	4,5	-	-	6,3
91-180	15,1	21,2	11,2	5,1	-	-	26,3
>180	28,8	0,1	0,1	28,8	-	-	28,9
Total	477,6	454,0	171,0	368,6	191,0	17,0	839,7

* 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	-0,2 %	-1,5 %	13,3 %	6,8 %
15-35	3,8 %	7,8 %	6,1 %	6,2 %
36-60	-	11,9 %	6,8 %	8,2 %
61-90	-	8,3 %	6,3 %	6,9 %
91-180	6,1 %	6,4 %	7,1 %	6,4 %
>180	-	9,1 %	7,5 %	7,6 %
Total	2,5 %	4,3 %	8,7 %	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	9 al 13 de Junio				16 al 20 de Junio				23 al 27 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	139	23	1696	2187	110	31	1579	1904	36	21	959	1353
Otros***	23	139	1017	1307	31	110	966	1089	21	36	915	759
Intragrupo	0	0	886	105	0	0	538	90	0	0	255	18
Total	162	162	3599	3599	141	141	3083	3083	57	57	2129	2129

* 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