

Fecha de Publicación: 12 de Junio de 2008
Fecha de Información: 10 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\$1038,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	198,9	266,1	114,1	193,9	147,0	-	460,1
15-35	294,5	260,2	140,8	240,1	88,0	23,0	523,3
36-60	6,4	1,3	1,3	6,4	-	-	7,7
61-90	1,5	0,6	0,6	1,5	-	-	2,2
91-180	5,1	5,1	5,1	5,1	-	-	10,2
>180	4,0	30,6	30,6	4,0	-	-	34,7
Total	510,5	563,9	292,6	451,2	235,0	23,0	1038,1

* 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	8,0 %	12,7 %	7,5 %	9,4 %
15-35	8,7 %	9,5 %	7,5 %	8,3 %
36-60	-	10,5 %	7,3 %	7,8 %
61-90	-	6,7 %	6,2 %	6,3 %
91-180	-	8,3 %	7,5 %	7,9 %
>180	-	7,9 %	7,5 %	7,8 %
Total	8,6 %	10,5 %	7,5 %	8,7 %

*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	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	24	1729	2397	110	31	1708	1954	36	21	1076	1358
Otros***	24	139	1080	1340	31	110	1011	1212	21	36	920	876
Intragrupo	0	0	1033	105	0	0	538	90	0	0	255	18
Total	163	163	3842	3842	141	141	3256	3256	57	57	2251	2251

* 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