

Fecha de Publicación: 13 de Junio de 2008
Fecha de Información: 11 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\$1064,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	149,1	291,5	192,0	148,6	99,0	-	440,1
15-35	179,4	311,5	233,5	104,4	18,0	15,0	430,9
36-60	13,4	2,1	2,1	13,4	-	-	15,5
61-90	8,2	7,1	4,1	5,2	-	-	12,4
91-180	155,3	1,9	1,9	105,3	-	50,0	157,2
>180	2,8	6,0	6,0	2,8	-	-	8,8
Total	508,2	620,3	439,8	379,7	117,0	65,0	1064,9

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

*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	1730	2397	113	31	1801	2230	36	21	1147	1379
Otros***	24	139	1080	1341	31	113	1187	1304	21	36	937	943
Intragrupo	0	0	1033	105	0	0	637	90	0	0	255	18
Total	163	163	3843	3843	144	144	3624	3624	57	57	2339	2339

* 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