

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2008
Fecha de Información: 13 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\$1047,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	224,3	228,2	81,2	217,3	140,0	-	445,5
15-35	237,5	328,4	168,4	155,5	88,0	10,0	493,8
36-60	47,8	12,6	0,5	35,6	-	-	48,3
61-90	4,5	4,1	4,1	4,5	-	-	8,5
91-180	21,6	3,7	3,4	21,3	-	-	25,0
>180	24,3	1,9	1,9	1,3	-	23,0	26,3
Total	560,0	578,9	259,4	435,5	228,0	33,0	1047,4

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

*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	21	1722	2400	113	34	2090	2663	37	21	1245	1412
Otros***	21	139	1083	1333	34	113	1330	1594	21	37	958	1029
Intragrupo	0	0	1033	105	0	0	927	90	0	0	255	18
Total	160	160	3837	3837	146	146	4347	4347	58	58	2458	2458

* 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