

Fecha de Publicación: 18 de Junio de 2008
Fecha de Información: 16 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\$865,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	228,6	142,1	115,1	192,6	16,0	25,0	359,6
15-35	220,1	273,1	81,1	145,1	122,0	5,0	423,2
36-60	45,2	1,7	1,7	45,2	-	-	46,8
61-90	2,4	3,1	3,1	2,4	-	-	5,5
91-180	18,4	6,9	6,9	18,4	-	-	25,2
>180	3,6	1,5	1,5	3,6	-	-	5,1
Total	518,2	428,3	209,3	407,2	138,0	30,0	865,5

* 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	5,3 %	-5,4 %	5,0 %	1,2 %
15-35	10,0 %	10,1 %	9,0 %	9,5 %
36-60	-	11,4 %	7,9 %	8,0 %
61-90	-	8,1 %	8,9 %	8,4 %
91-180	-	8,5 %	7,0 %	7,4 %
>180	-	8,6 %	6,7 %	7,3 %
Total	9,3 %	1,9 %	7,0 %	5,7 %

*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	16 al 20 de Junio				23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	113	32	2241	2775	38	22	1317	1443	37	16	999	1177
Otros***	32	113	1415	1709	22	38	989	1100	16	37	726	725
Intragrupo	0	0	943	115	0	0	255	18	0	0	268	91
Total	145	145	4599	4599	60	60	2561	2561	53	53	1993	1993

* 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