

Fecha de Publicación: 19 de Junio de 2008
Fecha de Información: 17 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\$1094,1 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	203,5	161,4	115,4	148,5	16,0	25,0	334,9
15-35	269,6	427,8	286,6	245,4	122,0	5,0	678,2
36-60	30,3	2,7	2,7	30,3	-	-	33,0
61-90	0,1	3,6	3,6	0,1	-	-	3,7
91-180	5,3	37,9	37,9	5,3	-	-	43,2
>180	0,0	1,1	1,1	0,0	-	-	1,1
Total	508,8	634,5	447,3	429,6	138,0	30,0	1094,1

* 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	5,7 %	10,2 %	10,3 %	9,8 %
15-35	9,2 %	8,1 %	8,1 %	8,2 %
36-60	-	9,0 %	7,7 %	7,8 %
61-90	-	9,0 %	6,4 %	8,9 %
91-180	-	8,7 %	7,3 %	8,6 %
>180	-	8,9 %	-	8,9 %
Total	6,9 %	8,7 %	8,8 %	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	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**	102	33	2367	3767	38	22	1486	1792	37	16	1141	1454
Otros***	33	102	2408	1835	22	38	1308	1240	16	37	1003	867
Intragrupo	0	0	943	115	0	0	255	18	0	0	268	91
Total	135	135	5717	5717	60	60	3049	3049	54	54	2412	2412

* 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