

Fecha de Publicación: 20 de Junio de 2008
Fecha de Información: 18 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\$1072,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	265,2	359,7	129,5	245,0	210,0	-	604,7
15-35	214,9	224,4	142,3	163,9	34,1	3,0	391,2
36-60	16,5	1,5	1,5	16,5	-	-	18,0
61-90	2,5	9,8	9,8	2,5	-	-	12,4
91-180	7,5	13,4	13,4	7,5	-	-	20,9
>180	10,0	20,1	15,1	5,0	-	-	25,1
Total	516,7	628,8	311,5	440,5	244,1	3,0	1072,3

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

*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	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**	103	33	2250	2828	38	22	1722	1896	37	16	1093	1216
Otros***	33	103	1418	1718	22	38	1165	1445	16	37	765	798
Intragrupo	0	0	993	115	0	0	482	28	0	0	268	112
Total	136	136	4661	4661	60	60	3370	3370	54	54	2126	2126

* 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