

Fecha de Publicación: 23 de Junio de 2008
Fecha de Información: 19 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\$1333,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	182,0	502,9	197,8	152,0	275,0	-	654,8
15-35	262,7	402,5	230,4	211,7	124,0	3,0	617,1
36-60	16,3	2,3	2,3	16,3	-	-	18,6
61-90	1,2	4,3	4,3	1,2	-	-	5,6
91-180	2,6	13,4	13,4	2,6	-	-	16,1
>180	16,5	4,5	4,5	16,5	-	-	21,0
Total	481,4	929,9	452,8	400,3	399,0	3,0	1333,2

* 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	62,2 %	-1,7 %	13,3 %	9,8 %
15-35	9,8 %	10,0 %	3,6 %	7,2 %
36-60	-	13,9 %	8,7 %	9,4 %
61-90	-	12,3 %	8,8 %	11,6 %
91-180	-	10,1 %	9,0 %	9,9 %
>180	-	8,3 %	7,8 %	7,9 %
Total	30,0 %	5,2 %	7,7 %	8,4 %

*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	2245	2828	39	23	1875	2387	38	16	1121	1228
Otros***	33	103	1418	1713	23	39	1351	1568	16	38	776	826
Intragrupo	0	0	993	115	0	0	757	28	0	0	268	112
Total	136	136	4656	4656	62	62	3982	3982	55	55	2165	2165

* 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