

Fecha de Publicación: 24 de Junio de 2008
Fecha de Información: 20 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\$909,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	238,6	205,1	105,1	238,6	100,0	-	443,7
15-35	211,0	218,5	171,5	153,0	5,0	16,0	387,5
36-60	3,1	0,8	0,8	3,1	-	-	3,9
61-90	13,2	8,6	3,6	8,2	-	-	16,8
91-180	7,3	31,6	31,6	7,3	-	-	39,0
>180	1,8	17,0	4,3	1,8	12,7	-	18,7
Total	475,0	481,7	317,0	411,9	117,7	16,0	909,7

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

*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

Sectores	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	2241	2814	45	23	2055	2591	39	17	1173	1229
Otros***	33	103	1404	1708	23	45	1455	1747	17	39	777	878
Intragrupo	0	0	993	115	0	0	857	28	0	0	268	112
Total	136	136	4637	4637	69	69	4366	4366	55	55	2218	2218

* 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