

Fecha de Publicación: 25 de Junio de 2008
Fecha de Información: 23 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\$1447,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	263,6	240,0	64,9	263,5	175,0	-	503,5
15-35	338,8	580,7	418,2	247,8	92,5	21,0	849,5
36-60	16,1	15,1	15,1	16,1	-	-	31,2
61-90	9,9	0,0	0,0	9,9	-	-	10,0
91-180	24,4	16,3	16,3	24,4	-	-	40,7
>180	12,1	0,0	0,0	12,1	-	-	12,1
Total	664,9	852,2	514,6	573,8	267,5	21,0	1447,0

* 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	20,1 %	19,9 %	-23,4 %	-17,9 %
15-35	11,6 %	7,0 %	8,7 %	8,0 %
36-60	-	12,7 %	6,4 %	9,5 %
61-90	-	7,3 %	5,2 %	5,2 %
91-180	-	6,6 %	8,1 %	7,5 %
>180	-	9,2 %	7,3 %	7,3 %
Total	11,6 %	8,0 %	-5,2 %	1,7 %

*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	23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	48	24	2182	2811	43	16	1290	1235	60	15	1641	1751
Otros***	24	48	1500	1875	16	43	783	994	15	60	1036	1261
Intragrupo	0	0	1032	28	0	0	268	112	0	0	447	112
Total	71	71	4714	4714	60	60	2341	2341	75	75	3124	3124

* 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