

Fecha de Publicación: 26 de Junio de 2008
Fecha de Información: 24 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\$899,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	130,8	216,5	151,5	130,8	65,0	-	347,3
15-35	196,7	223,3	198,8	179,2	22,0	15,0	417,4
36-60	21,9	30,9	30,9	21,9	-	-	52,8
61-90	10,1	0,0	0,0	10,1	-	-	10,2
91-180	39,3	5,5	5,5	39,3	-	-	44,8
>180	25,8	1,4	1,4	25,8	-	-	27,2
Total	424,6	477,6	388,1	407,1	87,0	15,0	899,7

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

*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**	47	24	2197	2886	45	16	1371	1346	61	15	1706	1777
Otros***	24	47	1530	1894	16	45	879	1075	15	61	1063	1326
Intragrupo	0	0	1082	28	0	0	283	112	0	0	447	112
Total	71	71	4808	4808	62	62	2533	2533	76	76	3215	3215

* 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