

Fecha de Publicación: 27 de Junio de 2008
Fecha de Información: 25 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\$1515,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	163,9	356,7	133,7	150,9	210,0	-	507,6
15-35	264,4	638,6	395,6	209,4	215,1	27,0	875,1
36-60	30,2	30,4	2,3	30,2	28,1	-	60,6
61-90	11,0	6,4	6,4	11,0	-	-	17,3
91-180	12,8	5,0	4,9	12,7	-	-	17,7
>180	36,6	0,4	0,4	36,6	-	-	37,0
Total	518,9	1037,5	543,2	450,8	453,2	27,0	1515,3

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

*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	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	27	2197	2885	46	16	1507	1659	61	20	1764	1869
Otros***	27	47	1529	1895	16	46	969	1199	20	61	1147	1376
Intragrupo	0	0	1082	28	0	0	493	112	0	0	447	112
Total	73	73	4808	4808	62	62	2970	2970	81	81	3358	3358

* 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