

Fecha de Publicación: 16 de Junio de 2008
Fecha de Información: 12 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\$1128,1 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	157,3	233,9	83,9	157,3	150,0	-	391,3
15-35	201,2	541,8	273,3	146,2	213,5	-	688,0
36-60	1,0	3,1	3,1	1,0	-	-	4,1
61-90	2,8	23,5	23,5	2,8	-	-	26,3
91-180	1,1	4,1	4,1	1,1	-	-	5,2
>180	4,5	8,8	8,8	4,5	-	-	13,3
Total	367,9	815,3	396,8	312,9	363,5	-	1128,1

* 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	-	9,3 %	7,9 %	8,4 %
15-35	8,2 %	8,5 %	8,1 %	8,3 %
36-60	-	9,5 %	14,1 %	10,6 %
61-90	-	9,1 %	7,6 %	9,0 %
91-180	-	8,3 %	13,7 %	9,5 %
>180	-	8,2 %	6,7 %	7,7 %
Total	8,2 %	8,7 %	8,0 %	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	9 al 13 de Junio				16 al 20 de Junio				23 al 27 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	139	24	1727	2398	113	33	1942	2443	36	21	1168	1404
Otros***	24	139	1081	1338	33	113	1250	1446	21	36	957	959
Intragrupo	0	0	1033	105	0	0	787	90	0	0	255	18
Total	163	163	3840	3840	146	146	3978	3978	57	57	2380	2380

* 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