

Fecha de Publicación: 9 de Julio de 2008
Fecha de Información: 07 de Julio de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1514,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	400,7	318,4	164,3	375,6	134,0	5,0	699,0
15-35	282,8	450,3	374,3	237,3	57,5	27,0	714,5
36-60	22,0	46,4	19,4	22,0	27,0	-	68,5
61-90	7,5	4,6	4,6	7,5	-	-	12,2
91-180	5,2	13,1	13,1	5,2	-	-	18,3
>180	0,0	1,7	1,7	0,0	-	-	1,7
Total	718,2	834,6	577,5	647,7	218,5	32,0	1514,2

* 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	8,2 %	-35,3 %	-12,0 %	-15,0 %
15-35	15,1 %	18,9 %	6,6 %	14,2 %
36-60	-	6,6 %	3,5 %	4,9 %
61-90	-	5,1 %	2,0 %	3,2 %
91-180	-	6,2 %	4,3 %	5,6 %
>180	-	7,6 %	-	7,6 %
Total	11,5 %	10,9 %	-2,7 %	4,0 %

*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	7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	72	22	2487	3174	100	25	1537	1844	85	37	1068	1655
Otros***	22	72	1691	2060	25	100	1101	1205	37	85	1205	835
Intragrupo	0	0	1168	112	0	0	463	53	0	0	293	75
Total	94	94	5347	5347	125	125	3101	3101	122	122	2566	2566

* 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