

Fecha de Publicación: 16 de Julio de 2008
Fecha de Información: 14 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\$751,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	195,1	179,7	87,7	155,1	52,0	-	334,8
15-35	166,9	198,9	166,9	136,9	30,0	28,0	363,9
36-60	26,1	14,8	14,8	26,1	-	-	40,9
61-90	5,8	3,2	3,2	5,8	-	-	9,0
91-180	0,3	2,6	2,6	0,3	-	-	2,9
>180	0,0	0,3	0,3	0,0	-	-	0,3
Total	394,3	399,4	275,4	324,3	82,0	28,0	751,7

* 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	-	-	-	-
15-35	7,6 %	5,6 %	3,7 %	4,7 %
36-60	-	12,6 %	8,4 %	9,9 %
61-90	-	6,7 %	6,5 %	6,6 %
91-180	-	8,8 %	8,7 %	8,8 %
>180	-	10,0 %	-	10,0 %
Total	-20,5 %	6,2 %	5,0 %	3,9 %

*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	14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	111	24	2005	2841	96	37	1452	1882	42	13	1270	1344
Otros***	24	111	1482	1572	37	96	1340	1142	13	42	1027	1064
Intragrupo	0	0	1008	82	0	0	310	77	0	0	173	62
Total	135	135	4495	4495	133	133	3102	3102	55	55	2469	2469

* 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