

Fecha de Publicación: 18 de Julio de 2008
Fecha de Información: 16 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\$838,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	203,3	160,8	70,8	193,3	80,0	-	354,0
15-35	163,9	222,5	164,5	150,9	45,0	-	373,4
36-60	40,0	0,4	0,4	40,0	-	-	40,4
61-90	3,6	14,9	14,9	3,6	-	-	18,4
91-180	0,1	4,5	4,5	0,1	-	-	4,6
>180	38,0	10,0	10,0	38,0	-	-	48,0
Total	448,9	413,1	265,1	425,9	125,0	-	838,9

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

*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**	112	21	2051	2883	96	37	1689	2072	42	13	1424	1364
Otros***	21	112	1524	1618	37	96	1428	1358	13	42	1047	1208
Intragrupo	0	0	1008	82	0	0	390	77	0	0	173	72
Total	134	134	4583	4583	133	133	3507	3507	55	55	2643	2643

* 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