

Fecha de Publicación: 24 de Julio de 2008
Fecha de Información: 22 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\$609,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	123,5	46,8	46,8	73,5	-	50,0	170,3
15-35	218,3	158,2	113,2	207,3	40,0	6,0	371,5
36-60	7,3	8,8	3,8	7,3	5,0	-	16,1
61-90	0,9	35,7	35,7	0,9	-	-	36,6
91-180	0,3	4,2	4,2	0,3	-	-	4,5
>180	0,6	10,0	10,0	0,6	-	-	10,6
Total	350,8	263,7	213,7	289,8	45,0	56,0	609,5

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

*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	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	97	34	2141	2579	68	13	1691	1777	62	18	1205	1322
Otros***	34	97	1640	1601	13	68	1191	1380	18	62	887	936
Intragrupo	0	0	590	191	0	0	346	72	0	0	258	92
Total	131	131	4371	4371	81	81	3228	3228	80	80	2350	2350

* 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