

Fecha de Publicación: 25 de Julio de 2008
Fecha de Información: 23 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\$653,3 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	130,2	113,5	83,3	130,0	30,0	-	243,5
15-35	86,8	287,2	220,2	76,8	61,0	4,0	368,0
36-60	11,1	5,8	5,8	11,1	-	-	16,9
61-90	0,2	9,5	8,9	0,2	0,6	-	9,7
91-180	0,2	10,4	10,4	0,2	-	-	10,6
>180	0,0	4,6	4,6	0,0	-	-	4,6
Total	228,5	431,0	333,2	218,4	91,6	4,0	653,3

* 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	0,0 %	3,8 %	5,6 %	4,9 %
15-35	7,3 %	8,2 %	7,5 %	8,0 %
36-60	-	9,0 %	8,4 %	8,6 %
61-90	-	9,2 %	6,0 %	9,1 %
91-180	-	8,0 %	7,9 %	8,0 %
>180	-	8,1 %	-	8,1 %
Total	7,1 %	7,1 %	6,4 %	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	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**	99	34	2141	2579	67	15	1802	1839	62	20	1225	1380
Otros***	34	98	1640	1601	15	67	1223	1490	20	62	945	956
Intragrupo	0	0	590	191	0	0	376	72	0	0	258	92
Total	132	132	4371	4371	82	82	3401	3401	82	82	2428	2428

* 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