

Fecha de Publicación: 30 de Julio de 2008
Fecha de Información: 28 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\$611,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	104,3	69,7	53,8	88,4	-	-	158,1
15-35	187,2	138,5	108,9	163,6	8,0	2,0	304,1
36-60	24,5	8,7	8,7	24,5	-	-	33,1
61-90	6,1	7,1	7,1	6,1	-	-	13,2
91-180	2,7	99,4	99,4	2,7	-	-	102,2
>180	0,0	0,5	0,5	0,0	-	-	0,5
Total	324,8	323,9	278,4	285,4	8,0	2,0	611,3

* 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	31,3 %	29,1 %	-21,1 %	1,7 %
15-35	14,7 %	7,3 %	6,5 %	7,4 %
36-60	-	1,8 %	10,4 %	8,2 %
61-90	-	4,1 %	10,4 %	7,0 %
91-180	-	5,2 %	10,0 %	5,3 %
>180	-	7,2 %	6,0 %	7,2 %
Total	21,7 %	10,1 %	-0,8 %	5,7 %

*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	28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	68	15	1975	2027	63	20	1439	1519	71	24	1048	1395
Otros***	15	68	1307	1649	20	63	1072	1148	24	71	1024	864
Intragrupo	0	0	466	72	0	0	258	102	0	0	240	53
Total	83	83	3748	3748	83	83	2769	2769	95	95	2312	2312

* 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