

Fecha de Publicación: 31 de Julio de 2008
Fecha de Información: 29 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\$538,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	62,2	64,3	49,2	22,1	-	25,0	111,5
15-35	240,8	132,1	85,6	147,3	-	47,0	326,5
36-60	25,4	8,9	8,9	25,4	-	-	34,3
61-90	1,4	1,5	1,5	1,4	-	-	2,9
91-180	57,8	16,7	3,7	44,8	-	-	61,6
>180	0,0	1,5	1,5	0,0	-	-	1,5
Total	387,7	225,1	150,5	241,1	-	72,0	538,2

* 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	34,0 %	12,4 %	14,7 %	16,9 %
15-35	9,8 %	9,1 %	4,9 %	7,0 %
36-60	-	7,4 %	7,6 %	7,5 %
61-90	-	8,0 %	7,6 %	7,8 %
91-180	4,7 %	8,5 %	7,6 %	7,0 %
>180	-	8,0 %	-	8,0 %
Total	13,8 %	10,1 %	6,5 %	8,8 %

*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	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	1999	2047	64	20	1470	1528	71	24	1069	1460
Otros***	15	68	1312	1658	20	64	1081	1154	24	71	1085	881
Intragrupo	0	0	466	72	0	0	258	127	0	0	240	53
Total	83	83	3777	3777	84	84	2809	2809	95	95	2394	2394

* 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