

Fecha de Publicación: 1 de Julio de 2008
Fecha de Información: 26 de Junio 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\$1244,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	146,0	366,6	216,5	145,9	150,0	-	512,5
15-35	316,1	249,6	209,6	256,6	9,0	28,5	534,6
36-60	46,0	6,8	0,4	46,0	6,4	-	52,8
61-90	43,0	2,2	1,4	43,0	0,8	-	45,2
91-180	35,7	21,6	21,6	35,7	-	-	57,3
>180	42,3	0,0	0,0	42,3	-	-	42,3
Total	629,1	646,8	449,5	569,6	166,2	28,5	1244,8

* 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	14,9 %	4,1 %	11,9 %	7,2 %
15-35	7,8 %	7,6 %	9,8 %	8,8 %
36-60	-	5,1 %	5,4 %	5,4 %
61-90	-	11,6 %	6,2 %	6,4 %
91-180	-	11,3 %	8,7 %	9,7 %
>180	-	-	6,9 %	6,9 %
Total	7,8 %	6,1 %	9,4 %	7,9 %

*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	23 al 27 de Junio				30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	45	27	2201	2889	46	16	1594	1905	64	20	1826	1998
Otros***	27	45	1533	1899	16	46	1065	1286	20	64	1276	1439
Intragrupo	0	0	1082	28	0	0	643	112	0	0	447	112
Total	72	72	4816	4816	62	62	3303	3303	84	84	3549	3549

* 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