

Fecha de Publicación: 2 de Julio de 2008
Fecha de Información: 27 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\$866,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,7	113,1	113,1	76,7	-	-	189,8
15-35	333,5	167,7	122,7	296,5	8,0	-	464,2
36-60	19,0	0,9	0,9	19,0	-	-	20,0
61-90	30,8	24,5	24,5	30,8	-	-	55,3
91-180	79,2	6,0	6,0	79,2	-	-	85,1
>180	38,7	13,2	13,2	38,7	-	-	51,9
Total	577,9	325,4	280,4	540,9	8,0	-	866,3

* 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	-	30,9 %	-2,6 %	14,8 %
15-35	17,0 %	3,5 %	4,9 %	5,5 %
36-60	-	-1,4 %	0,6 %	0,5 %
61-90	-	-1,4 %	10,9 %	5,4 %
91-180	-	5,3 %	6,7 %	6,6 %
>180	-	9,7 %	7,1 %	7,7 %
Total	17,0 %	12,6 %	4,5 %	7,4 %

*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	28	2203	2889	46	17	1623	1944	65	21	1872	2070
Otros***	28	45	1533	1901	17	46	1104	1314	21	65	1348	1484
Intragrupo	0	0	1082	28	0	0	643	112	0	0	447	112
Total	73	73	4818	4818	63	63	3370	3370	86	86	3667	3667

* 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