

Fecha de Publicación: 3 de Julio de 2008
Fecha de Información: 01 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\$1118,9 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	141,6	323,2	98,2	126,6	210,0	-	449,8
15-35	272,4	207,9	167,2	255,4	25,7	2,0	465,3
36-60	24,6	1,9	1,9	24,6	-	-	26,5
61-90	12,1	9,5	9,4	12,0	-	-	21,5
91-180	47,7	36,1	36,1	47,7	-	-	83,8
>180	52,4	19,6	19,6	52,4	-	-	72,0
Total	550,7	598,2	332,4	518,7	235,7	2,0	1118,9

* 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	32,8 %	-38,8 %	8,6 %	-1,9 %
15-35	-16,0 %	13,2 %	5,2 %	7,3 %
36-60	-	2,1 %	10,2 %	9,7 %
61-90	7,6 %	10,8 %	8,1 %	9,3 %
91-180	-	13,7 %	7,1 %	10,0 %
>180	-	9,1 %	6,8 %	7,5 %
Total	8,4 %	3,7 %	6,6 %	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	30 de Jun. al 4 de Julio				7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	44	17	1626	1946	66	21	1964	2393	98	24	1362	1703
Otros***	17	44	1107	1318	21	66	1445	1562	24	98	989	1047
Intragrupo	0	0	643	112	0	0	657	112	0	0	446	48
Total	61	61	3376	3376	87	87	4067	4067	122	122	2798	2798

* 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