

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2008
Fecha de Información: 03 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\$977,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	175,4	199,5	89,4	135,3	70,0	-	334,8
15-35	312,0	269,3	191,3	225,0	22,0	31,0	525,3
36-60	34,5	7,5	7,3	34,3	-	-	41,8
61-90	3,9	44,4	44,4	3,9	-	-	48,4
91-180	3,8	3,4	3,4	3,8	-	-	7,3
>180	1,0	18,8	18,8	1,0	-	-	19,8
Total	530,6	543,1	354,8	403,3	92,0	31,0	977,4

* 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	30,3 %	9,0 %	10,5 %	13,0 %
15-35	1,5 %	7,0 %	9,0 %	7,3 %
36-60	8,1 %	10,9 %	9,1 %	9,4 %
61-90	-	8,3 %	7,1 %	8,2 %
91-180	-	9,0 %	9,0 %	9,0 %
>180	-	8,1 %	6,5 %	8,1 %
Total	13,5 %	7,9 %	9,5 %	9,3 %

*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**	43	17	1651	1972	70	22	2212	2952	100	25	1420	1738
Otros***	17	43	1107	1318	22	70	1600	1785	25	100	1020	1114
Intragrupo	0	0	643	112	0	0	1038	112	0	0	459	48
Total	60	60	3401	3401	92	92	4849	4849	125	125	2899	2899

* 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