

Fecha de Publicación: 10 de Julio de 2008
Fecha de Información: 08 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\$630,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	168,9	73,3	50,9	98,4	12,0	60,0	231,7
15-35	196,0	235,4	129,0	120,6	37,0	6,0	362,0
36-60	25,1	23,3	0,3	2,1	-	-	25,4
61-90	3,0	6,0	6,0	3,0	-	-	9,0
91-180	0,6	2,0	2,0	0,6	-	-	2,6
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	393,5	340,0	188,1	224,7	49,0	66,0	630,7

* 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	-2,5 %	-3,3 %	19,2 %	10,2 %
15-35	9,0 %	10,7 %	6,3 %	8,7 %
36-60	4,1 %	7,9 %	5,9 %	4,3 %
61-90	-	7,6 %	10,5 %	8,6 %
91-180	-	7,8 %	6,3 %	7,4 %
>180	-	-	-	-
Total	6,8 %	6,8 %	11,7 %	8,9 %

*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	7 al 11 de Julio				14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	73	22	2557	3185	100	25	1613	1900	85	37	1149	1684
Otros***	22	73	1703	2070	25	100	1141	1276	37	85	1229	911
Intragrupo	0	0	1168	172	0	0	475	53	0	0	293	75
Total	95	95	5428	5428	125	125	3229	3229	122	122	2671	2671

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo