

Fecha de Publicación: 11 de Julio de 2008
Fecha de Información: 09 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\$713,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	174,8	85,5	34,0	128,3	5,0	-	213,8
15-35	231,5	221,2	142,2	149,5	22,0	25,0	395,7
36-60	4,5	0,9	0,9	4,5	-	-	5,4
61-90	0,0	2,7	2,7	0,0	-	-	2,7
91-180	0,4	13,7	13,7	0,4	-	-	14,1
>180	5,0	82,1	52,1	0,0	25,0	-	82,1
Total	416,2	406,0	245,5	282,7	52,0	25,0	713,7

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

*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**	75	22	2558	3186	100	24	1747	1981	95	37	1210	1690
Otros***	22	75	1703	2071	24	100	1175	1364	37	95	1230	972
Intragrupo	0	0	1168	172	0	0	475	53	0	0	298	75
Total	96	96	5428	5428	124	124	3397	3397	132	132	2738	2738

* 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