

Fecha de Publicación: 15 de Julio de 2008
Fecha de Información: 11 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\$785,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	168,3	240,0	127,0	96,8	73,0	31,5	368,4
15-35	234,7	167,9	110,4	180,2	19,0	16,0	364,1
36-60	8,8	35,8	0,1	0,8	27,7	-	36,6
61-90	1,0	0,1	0,1	1,0	-	-	1,1
91-180	9,1	2,7	2,7	9,1	-	-	11,8
>180	3,6	0,0	0,0	3,6	-	-	3,6
Total	425,6	446,5	240,2	291,5	119,7	47,5	785,5

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

*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**	76	22	2558	3186	108	24	1977	2742	96	37	1290	1799
Otros***	22	76	1703	2071	24	108	1423	1545	37	96	1309	1020
Intragrupo	0	0	1168	172	0	0	968	82	0	0	298	77
Total	98	98	5429	5429	132	132	4369	4369	133	133	2897	2897

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