

Fecha de Publicación: 17 de Julio de 2008
Fecha de Información: 15 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\$736,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	131,1	87,3	75,3	109,1	-	10,0	206,4
15-35	213,1	241,6	145,6	188,1	75,0	4,0	433,7
36-60	19,2	58,8	58,8	19,2	-	-	78,0
61-90	4,4	0,8	0,8	4,4	-	-	5,2
91-180	8,4	3,9	3,9	8,4	-	-	12,3
>180	0,5	0,0	0,0	0,5	-	-	0,5
Total	376,7	392,4	284,4	329,7	75,0	14,0	736,1

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

*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	14 al 18 de Julio				21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	112	22	2049	2882	95	37	1525	1931	42	13	1360	1346
Otros***	22	112	1523	1616	37	95	1376	1204	13	42	1029	1145
Intragrupo	0	0	1008	82	0	0	310	77	0	0	173	72
Total	134	134	4580	4580	132	132	3212	3212	55	55	2562	2562

* 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