

Fecha de Publicación: 22 de Julio de 2008
Fecha de Información: 18 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\$1140,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	260,6	381,3	126,3	152,3	210,0	63,2	596,8
15-35	185,4	322,1	180,1	157,3	128,0	14,0	493,5
36-60	23,5	1,5	1,5	23,5	-	-	25,0
61-90	10,6	0,0	0,0	10,5	-	-	10,6
91-180	12,6	1,3	1,3	12,6	-	-	13,9
>180	0,7	0,0	0,0	0,7	-	-	0,7
Total	493,3	706,2	309,1	357,0	338,0	77,2	1140,4

* 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	-2,8 %	-3,8 %	14,7 %	4,3 %
15-35	2,7 %	4,3 %	10,0 %	6,8 %
36-60	-	-5,1 %	6,4 %	5,7 %
61-90	5,0 %	-	10,2 %	10,1 %
91-180	-	12,5 %	8,5 %	8,8 %
>180	-	8,9 %	8,8 %	8,8 %
Total	-1,5 %	1,4 %	11,3 %	5,9 %

*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	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**	113	20	2049	2884	99	34	2021	2511	66	13	1563	1659
Otros***	20	113	1525	1616	34	99	1596	1556	13	66	1118	1297
Intragrupo	0	0	1008	82	0	0	590	141	0	0	346	72
Total	134	134	4582	4582	133	133	4208	4208	79	79	3027	3027

* 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