

Fecha de Publicación: 23 de Julio de 2008
Fecha de Información: 21 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\$537,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	124,7	151,5	81,5	54,7	-	-	206,2
15-35	201,9	136,1	55,1	102,9	10,0	28,0	267,1
36-60	4,5	8,4	8,4	4,5	-	-	12,9
61-90	0,1	0,4	0,4	0,1	-	-	0,5
91-180	0,7	5,7	5,7	0,7	-	-	6,4
>180	39,5	23,1	5,1	21,5	-	-	44,6
Total	371,4	325,2	156,2	184,4	10,0	28,0	537,6

* 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	22,3 %	-4,0 %	16,8 %	9,9 %
15-35	9,4 %	9,5 %	6,8 %	8,3 %
36-60	-	7,9 %	7,3 %	7,7 %
61-90	-	7,4 %	6,3 %	7,2 %
91-180	-	9,1 %	7,1 %	8,9 %
>180	7,5 %	6,8 %	6,7 %	7,0 %
Total	14,3 %	2,3 %	9,8 %	8,8 %

*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	21 al 25 de Julio				28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	99	34	2079	2567	68	13	1633	1744	62	18	1171	1307
Otros***	34	99	1627	1589	13	68	1158	1321	18	62	871	902
Intragrupo	0	0	590	141	0	0	346	72	0	0	258	92
Total	133	133	4296	4296	81	81	3137	3137	80	80	2300	2300

* 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