

Fecha de Publicación: 4 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 31 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\$776,9 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	123,7	330,8	124,0	93,7	176,7	-	424,5
15-35	100,2	226,3	145,7	75,0	60,4	5,0	306,3
36-60	1,6	8,1	8,1	1,6	-	-	9,7
61-90	19,2	1,4	0,8	19,2	0,6	-	20,5
91-180	2,6	9,5	9,5	2,6	-	-	12,2
>180	3,8	0,0	0,0	3,8	-	-	3,8
Total	251,1	576,0	288,0	195,9	237,8	5,0	776,9

* 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	19,5 %	1,7 %	10,2 %	7,0 %
15-35	7,9 %	7,3 %	7,0 %	7,2 %
36-60	-	8,6 %	7,1 %	8,3 %
61-90	-	8,0 %	6,0 %	6,1 %
91-180	-	7,4 %	6,7 %	7,3 %
>180	-	-	6,6 %	6,6 %
Total	14,8 %	4,9 %	8,4 %	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	28 de Jul. al 1 de Agosto				4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	69	15	2000	2049	65	20	1600	1846	71	24	1176	1559
Otros***	15	69	1314	1659	20	65	1221	1272	24	71	1152	968
Intragrupo	0	0	466	72	0	0	423	127	0	0	251	53
Total	84	84	3780	3780	85	85	3245	3245	95	95	2579	2579

* 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