

Fecha de Publicación: 20 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 15 de Agosto 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\$718,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	168,2	329,2	149,1	128,1	150,0	10,0	467,3
15-35	125,5	83,7	60,7	67,0	-	35,5	186,2
36-60	2,2	17,3	17,3	2,2	-	-	19,5
61-90	7,7	1,9	1,9	7,7	-	-	9,6
91-180	10,5	19,3	9,3	10,5	10,0	-	29,9
>180	5,2	1,1	1,1	5,2	-	-	6,3
Total	319,4	452,4	239,4	220,8	160,0	45,5	718,8

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

*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	11 al 15 de Agosto				18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	80	35	1726	2242	34	17	1386	1948	66	24	1429	1913
Otros***	35	80	1484	1395	17	34	1311	1118	24	66	1182	1101
Intragrupo	0	0	551	125	0	0	451	82	0	0	498	96
Total	115	115	3762	3762	51	51	3148	3148	90	90	3110	3110

* 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