

Fecha de Publicación: 21 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 19 de Agosto de 2008¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$893,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	269,0	226,1	65,7	158,6	50,0	-	384,7
15-35	223,5	369,3	189,8	95,2	73,5	22,2	486,8
36-60	2,3	3,8	3,8	2,3	-	-	6,1
61-90	0,8	1,6	1,6	0,8	-	-	2,4
91-180	3,5	4,3	4,3	3,5	-	-	7,8
>180	5,4	0,1	0,1	5,4	-	-	5,5
Total	504,5	605,3	265,3	265,9	123,5	22,2	893,4

* 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	17,2 %	-5,1 %	3,7 %	6,4 %
15-35	8,0 %	8,5 %	7,5 %	8,1 %
36-60	-	7,2 %	5,7 %	6,6 %
61-90	-	7,7 %	5,6 %	7,0 %
91-180	-	7,2 %	6,9 %	7,1 %
>180	-	7,3 %	7,1 %	7,1 %
Total	12,7 %	5,1 %	5,2 %	7,3 %

*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	18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	17	1413	1973	66	24	1618	2108	7	12	632	732
Otros***	17	34	1336	1145	24	66	1217	1179	12	7	526	485
Intragrupo	0	0	451	82	0	0	548	96	0	0	97	38
Total	51	51	3200	3200	90	90	3384	3384	19	19	1254	1254

* 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