

Fecha de Publicación: 27 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 25 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\$780,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70,2	210,3	113,1	63,0	90,0	-	273,3
15-35	322,0	185,3	58,3	209,0	52,0	38,0	432,3
36-60	27,1	5,2	5,2	27,1	-	-	32,3
61-90	1,2	4,5	4,5	1,2	-	-	5,7
91-180	1,4	34,6	34,6	1,4	-	-	36,0
>180	0,8	0,0	0,0	0,8	-	-	0,8
Total	422,7	439,8	215,6	302,5	142,0	38,0	780,4

* 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	27,1 %	3,6 %	22,5 %	10,9 %
15-35	8,2 %	7,6 %	5,9 %	6,7 %
36-60	-	6,8 %	8,8 %	8,5 %
61-90	-	7,9 %	6,6 %	7,6 %
91-180	-	6,4 %	7,1 %	6,4 %
>180	-	-	6,9 %	6,9 %
Total	9,8 %	5,3 %	9,5 %	8,0 %

*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	25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	25	1976	2480	7	12	780	1039	82	21	796	1177
Otros***	25	67	1452	1486	12	7	716	606	21	82	775	577
Intragrupo	0	0	633	96	0	0	187	38	0	0	219	36
Total	92	92	4062	4062	18	18	1683	1683	103	103	1790	1790

* 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