

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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo