

Fecha de Publicación: 1 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 30 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\$543,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	83,4	73,5	71,2	81,1	-	-	154,6
15-35	163,3	136,6	49,6	112,2	75,0	39,0	287,8
36-60	34,0	23,5	1,1	22,0	10,4	-	45,5
61-90	18,9	1,9	0,7	18,9	1,2	-	20,8
91-180	2,0	1,5	1,5	2,0	-	-	3,4
>180	26,2	10,5	5,5	21,2	-	-	31,7
Total	327,8	247,4	129,5	257,5	86,6	39,0	543,9

* 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	-16,6 %	-7,1 %	20,9 %	7,4 %
15-35	15,3 %	6,0 %	5,5 %	6,3 %
36-60	7,0 %	3,4 %	7,6 %	7,3 %
61-90	-	5,2 %	7,3 %	7,2 %
91-180	-	4,8 %	7,3 %	6,2 %
>180	7,0 %	6,9 %	7,1 %	7,0 %
Total	8,4 %	-1,2 %	10,8 %	6,9 %

*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	14	2000	2049	65	20	1542	1580	71	24	1104	1483
Otros***	14	69	1314	1659	20	65	1131	1224	24	71	1109	916
Intragrupo	0	0	466	72	0	0	258	127	0	0	240	53
Total	83	83	3780	3780	85	85	2931	2931	95	95	2453	2453

* 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