

Fecha de Publicación: 6 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 04 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\$315,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	40,6	75,1	75,0	40,5	-	-	115,6
15-35	118,1	68,2	63,1	106,0	-	7,0	181,2
36-60	0,4	4,8	4,8	0,4	-	-	5,2
61-90	0,0	0,4	0,4	0,0	-	-	0,4
91-180	3,5	10,0	10,0	3,5	-	-	13,5
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	162,6	158,5	153,3	150,4	-	7,0	315,9

* 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	-5,7 %	10,2 %	7,9 %	9,4 %
15-35	6,1 %	11,4 %	6,5 %	8,3 %
36-60	-	6,5 %	6,3 %	6,5 %
61-90	-	9,3 %	-	9,3 %
91-180	-	7,8 %	7,0 %	7,6 %
>180	-	7,9 %	-	7,9 %
Total	5,8 %	10,4 %	6,9 %	8,6 %

*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	4 al 8 de Agosto				11 al 15 de Agosto				18 al 22 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	66	21	1773	2029	70	26	1329	1643	23	16	1019	1506
Otros***	21	66	1315	1414	26	70	1236	1078	16	23	1027	829
Intragrupo	0	0	483	127	0	0	251	95	0	0	361	72
Total	87	87	3571	3571	96	96	2817	2817	39	39	2407	2407

* 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