

Fecha de Publicación: 8 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 05 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\$460,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	116,5	82,7	67,4	101,2	-	-	184,0
15-35	106,2	153,2	120,2	85,2	15,0	3,0	241,4
36-60	6,4	9,8	3,8	0,4	-	-	10,1
61-90	15,7	3,3	0,3	12,7	-	-	15,9
91-180	0,7	2,2	2,2	0,7	-	-	2,9
>180	0,0	6,1	6,1	0,0	-	-	6,1
Total	245,4	257,2	199,9	200,1	15,0	3,0	460,4

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

*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

Sectores	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	1771	2029	71	26	1449	1719	23	16	1036	1520
Otros***	21	66	1315	1413	26	71	1297	1184	16	23	1036	841
Intragrupo	0	0	483	127	0	0	251	95	0	0	361	72
Total	87	87	3570	3570	97	97	2998	2998	39	39	2432	2432

* 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