

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 06 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\$917,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	88,4	321,0	54,0	71,4	250,0	-	392,4
15-35	183,9	320,9	273,2	167,9	31,7	-	488,8
36-60	6,4	10,0	10,0	6,4	-	-	16,4
61-90	1,0	3,3	3,3	1,0	-	-	4,3
91-180	2,5	10,6	10,6	2,4	-	-	13,1
>180	2,0	0,0	0,0	2,0	-	-	2,0
Total	284,2	665,8	351,1	251,2	281,7	-	917,0

* 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	16,4 %	3,6 %	4,8 %	5,7 %
15-35	8,3 %	8,1 %	6,9 %	7,7 %
36-60	-	2,9 %	3,9 %	3,3 %
61-90	-	6,9 %	6,9 %	6,9 %
91-180	6,4 %	6,9 %	6,9 %	6,9 %
>180	-	8,2 %	6,5 %	6,5 %
Total	12,5 %	7,2 %	6,2 %	7,1 %

*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	20	1772	2030	74	26	1509	2013	26	16	1088	1550
Otros***	20	66	1315	1413	26	74	1341	1243	16	26	1049	876
Intragrupo	0	0	483	127	0	0	501	95	0	0	361	72
Total	87	87	3570	3570	100	100	3352	3352	42	42	2498	2498

* 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