

Fecha de Publicación: 12 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 08 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\$535,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	106,1	124,5	93,4	105,0	30,0	-	229,5
15-35	184,5	102,0	79,5	155,0	7,0	14,0	271,0
36-60	10,5	0,0	0,0	10,5	-	-	10,6
61-90	3,3	0,4	0,4	3,3	-	-	3,7
91-180	7,4	8,4	0,2	7,4	8,2	-	15,9
>180	5,2	0,0	0,0	5,2	-	-	5,2
Total	317,0	235,3	173,5	286,4	45,2	14,0	535,7

* 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	28,2 %	4,9 %	1,5 %	3,4 %
15-35	6,1 %	7,0 %	4,0 %	5,1 %
36-60	-	-8,3 %	6,6 %	6,6 %
61-90	-	11,8 %	6,3 %	6,9 %
91-180	-	8,1 %	6,3 %	6,3 %
>180	-	-	6,7 %	6,7 %
Total	7,5 %	5,9 %	3,5 %	4,6 %

*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**	67	20	1772	2030	81	35	1560	2094	26	16	1137	1584
Otros***	20	67	1315	1413	35	81	1391	1293	16	26	1083	924
Intragrupo	0	0	483	127	0	0	531	95	0	0	361	72
Total	88	88	3570	3570	115	115	3482	3482	42	42	2580	2580

* 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