

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 12 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\$612,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	63,3	113,8	93,7	63,2	20,0	-	177,0
15-35	78,3	237,1	179,0	50,3	49,2	19,0	306,4
36-60	3,6	65,0	65,0	3,6	-	-	68,6
61-90	18,4	3,6	3,6	18,4	-	-	22,0
91-180	18,4	17,3	1,8	18,4	15,5	-	35,7
>180	2,7	0,5	0,5	2,7	-	-	3,2
Total	184,7	437,3	343,6	156,6	84,6	19,0	612,9

* 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	17,2 %	-1,2 %	12,9 %	4,3 %
15-35	15,3 %	6,6 %	6,8 %	7,0 %
36-60	-	7,3 %	6,0 %	7,2 %
61-90	7,9 %	7,6 %	4,4 %	4,9 %
91-180	-	8,8 %	6,7 %	6,9 %
>180	-	8,4 %	7,1 %	7,3 %
Total	15,3 %	4,7 %	8,9 %	6,1 %

*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

Sectores	11 al 15 de Agosto				18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	81	35	1717	2241	29	17	1211	1659	66	23	1221	1527
Otros***	35	81	1483	1386	17	29	1157	998	23	66	1051	897
Intragrupo	0	0	551	125	0	0	361	72	0	0	248	96
Total	116	116	3752	3752	46	46	2729	2729	89	89	2520	2520

* 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