

Fecha de Publicación: 15 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 13 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\$608,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,6	69,6	49,6	47,6	20,0	-	117,3
15-35	177,0	233,1	99,6	130,8	109,3	22,0	385,9
36-60	16,3	10,0	10,0	16,3	-	-	26,3
61-90	5,3	2,0	2,0	5,3	-	-	7,3
91-180	14,7	21,9	21,9	14,7	-	-	36,7
>180	8,4	27,0	27,0	8,4	-	-	35,4
Total	269,3	363,7	210,2	223,1	129,3	22,0	608,8

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

*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	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	1719	2242	29	17	1238	1726	66	24	1266	1530
Otros***	35	81	1485	1388	17	29	1204	1025	24	66	1054	942
Intragrupo	0	0	551	125	0	0	381	72	0	0	248	96
Total	116	116	3756	3756	46	46	2823	2823	89	89	2568	2568

* 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: $((Tasa\ Pactada/Promedio\ SET\ FX) \wedge (365/Plazo)) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo