

Fecha de Publicación: 19 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 14 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\$1003,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	157,4	275,7	85,7	137,4	170,0	-	413,1
15-35	287,6	235,6	174,6	210,6	16,0	32,0	478,2
36-60	30,4	3,8	3,8	30,4	-	-	34,2
61-90	13,5	16,9	16,9	13,5	-	-	30,4
91-180	24,7	11,4	11,4	4,7	-	20,0	36,1
>180	6,4	5,2	5,2	6,4	-	-	11,6
Total	520,0	548,7	297,7	403,0	186,0	52,0	1003,7

* 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	-25,0 %	-3,5 %	10,8 %	2,8 %
15-35	2,1 %	6,2 %	7,9 %	6,6 %
36-60	-	8,2 %	4,4 %	4,9 %
61-90	-	9,9 %	9,7 %	9,8 %
91-180	-	6,6 %	7,8 %	6,9 %
>180	-	7,1 %	6,8 %	6,9 %
Total	-6,2 %	3,7 %	8,7 %	5,4 %

*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	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**	80	36	1717	2242	28	17	1327	1867	66	24	1345	1665
Otros***	36	80	1484	1385	17	28	1255	1094	24	66	1089	1021
Intragrupo	0	0	551	125	0	0	451	72	0	0	348	96
Total	116	116	3752	3752	45	45	3033	3033	89	89	2783	2783

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