

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 21 de Agosto de 2008¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$777,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	146,0	142,9	107,8	130,9	20,0	-	273,8
15-35	171,7	253,7	177,7	138,7	56,0	13,0	405,4
36-60	6,1	25,1	25,1	6,1	-	-	31,2
61-90	0,3	4,4	4,4	0,3	-	-	4,6
91-180	1,9	31,6	31,6	1,9	-	-	33,5
>180	10,0	18,5	18,5	0,0	-	10,0	28,5
Total	335,9	476,3	365,2	277,8	76,0	23,0	777,1

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

*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	18 al 22 de Agosto				25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	34	17	1404	1973	66	25	1857	2281	7	13	717	804
Otros***	17	34	1336	1136	25	66	1319	1367	13	7	577	551
Intragrupo	0	0	451	82	0	0	568	96	0	0	97	38
Total	51	51	3190	3190	91	91	3744	3744	19	19	1392	1392

* 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