

Fecha de Publicación: 26 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 22 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\$538,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	116,7	229,5	164,5	116,7	65,0	-	346,2
15-35	115,9	28,0	28,0	106,9	-	9,0	143,9
36-60	16,1	3,5	3,5	16,1	-	-	19,6
61-90	2,7	1,2	1,2	2,7	-	-	3,9
91-180	5,6	8,0	8,0	5,6	-	-	13,5
>180	1,8	9,0	9,0	1,8	-	-	10,8
Total	258,8	279,3	214,3	249,8	65,0	9,0	538,1

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

*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	18	1404	1973	67	25	1945	2439	7	12	742	875
Otros***	18	34	1336	1136	25	67	1412	1455	12	7	649	576
Intragrupo	0	0	451	82	0	0	633	96	0	0	97	38
Total	52	52	3190	3190	92	92	3989	3989	18	18	1489	1489

* 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