

Fecha de Publicación: 28 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 26 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\$714,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,6	99,4	84,3	98,4	-	-	197,9
15-35	133,2	274,7	207,7	106,2	47,0	7,0	387,9
36-60	16,6	0,1	0,1	16,6	-	-	16,7
61-90	1,1	30,1	30,1	1,1	-	-	31,2
91-180	47,3	11,5	1,5	37,3	-	-	48,8
>180	16,4	20,0	15,0	11,4	-	-	31,4
Total	328,2	435,8	338,7	271,1	47,0	7,0	714,0

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

*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	25 al 29 de Agosto				1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	26	2033	2519	9	12	816	1082	82	21	823	1217
Otros***	26	67	1476	1528	12	9	759	642	21	82	815	603
Intragrupo	0	0	633	96	0	0	187	38	0	0	219	36
Total	93	93	4143	4143	21	21	1762	1762	103	103	1857	1857

* 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