

Fecha de Publicación: 29 de Agosto de 2008
Fecha de Información: 27 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\$1268,8 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	155,0	155,0	67,6	154,6	87,0	-	309,6
15-35	434,8	305,0	256,7	332,6	16,0	70,0	707,5
36-60	20,0	0,7	0,6	20,0	-	-	20,7
61-90	7,3	123,3	116,2	0,2	-	-	123,5
91-180	8,0	45,2	10,2	3,0	30,0	-	48,1
>180	4,4	55,0	35,0	4,4	20,0	-	59,4
Total	629,4	684,2	486,4	514,6	153,0	70,0	1268,8

* 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	30,8 %	0,4 %	0,3 %	0,4 %
15-35	8,8 %	7,0 %	4,9 %	6,0 %
36-60	3,6 %	3,9 %	8,4 %	8,2 %
61-90	10,2 %	7,2 %	5,2 %	7,4 %
91-180	7,1 %	7,3 %	6,8 %	7,1 %
>180	-	7,7 %	7,2 %	7,7 %
Total	9,1 %	6,2 %	3,7 %	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**	68	25	2033	2519	11	12	906	1234	82	21	921	1244
Otros***	25	68	1476	1528	12	11	824	732	21	82	842	702
Intragrupo	0	0	633	96	0	0	274	38	0	0	219	36
Total	93	93	4143	4143	22	22	2004	2004	103	103	1982	1982

* 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