

Fecha de Publicación: 1 de Septiembre de 2008

Fecha de Información: 28 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\$947,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	116,4	219,8	63,4	101,4	141,4	-	321,2
15-35	251,1	215,7	80,0	189,2	87,2	13,4	418,3
36-60	71,1	13,4	13,4	71,1	-	-	84,4
61-90	3,4	7,7	7,7	3,4	-	-	11,1
91-180	32,3	61,3	46,3	17,3	-	-	78,6
>180	8,4	24,9	24,9	8,4	-	-	33,3
Total	482,8	542,8	235,7	390,9	228,6	13,4	947,0

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

*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**	70	25	2032	2519	10	12	960	1432	84	21	984	1266
Otros***	25	70	1476	1527	12	10	880	786	21	84	849	749
Intragrupo	0	0	633	96	0	0	415	38	0	0	219	36
Total	95	95	4142	4142	22	22	2256	2256	104	104	2052	2052

* 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