

Fecha de Publicación: 2 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 29 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\$1070,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	137,7	321,9	147,9	95,7	132,0	-	417,6
15-35	214,2	256,0	227,0	188,2	15,0	12,0	456,2
36-60	84,3	56,0	34,0	62,3	-	-	118,3
61-90	9,3	7,6	7,6	9,3	-	-	16,9
91-180	25,1	19,2	19,2	25,1	-	-	44,3
>180	7,1	10,0	10,0	7,1	-	-	17,1
Total	477,6	670,7	445,7	387,6	147,0	12,0	1070,3

* 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	7,5 %	24,0 %	0,2 %	13,6 %
15-35	6,1 %	7,9 %	7,1 %	7,5 %
36-60	6,2 %	8,0 %	5,8 %	6,5 %
61-90	-	7,2 %	6,9 %	7,0 %
91-180	-	7,8 %	6,7 %	7,2 %
>180	-	8,2 %	6,5 %	7,5 %
Total	6,9 %	13,2 %	5,1 %	9,3 %

*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**	69	25	2032	2519	11	12	1039	1536	84	21	1041	1481
Otros***	25	69	1476	1527	12	11	962	843	21	84	911	787
Intragrupo	0	0	633	96	0	0	415	38	0	0	351	36
Total	94	94	4142	4142	23	23	2416	2416	105	105	2304	2304

* 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