

Fecha de Publicación: 3 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 01 de Septiembre 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\$200,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	35,0	8,3	8,3	35,0	-	-	43,3
15-35	42,5	52,2	52,2	42,5	-	-	94,7
36-60	23,4	0,4	0,4	23,4	-	-	23,8
61-90	4,4	0,0	0,0	4,4	-	-	4,4
91-180	17,3	15,3	0,3	2,3	-	-	17,6
>180	16,7	15,0	0,0	1,7	-	-	16,7
Total	139,3	91,2	61,2	109,3	-	-	200,4

* 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	-	10,7 %	8,8 %	9,1 %
15-35	-	5,9 %	-5,1 %	0,9 %
36-60	-	11,4 %	2,4 %	2,5 %
61-90	-	4,8 %	7,2 %	7,2 %
91-180	2,0 %	6,8 %	6,9 %	2,7 %
>180	5,8 %	-	6,9 %	5,9 %
Total	3,9 %	6,6 %	1,9 %	3,6 %

*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	1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	12	1052	1548	85	21	1061	1482	62	24	1118	1107
Otros***	12	12	970	852	21	85	916	810	24	62	734	781
Intragrupo	0	0	415	38	0	0	351	36	0	0	194	157
Total	24	24	2437	2437	105	105	2328	2328	87	87	2046	2046

* 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