

Fecha de Publicación: 4 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 02 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\$753,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	136,3	201,1	101,1	133,5	100,0	2,8	337,4
15-35	178,5	198,0	85,1	122,5	102,8	46,0	366,5
36-60	5,2	3,9	3,9	5,2	-	-	9,2
61-90	2,3	2,0	2,0	2,3	-	-	4,3
91-180	13,6	3,7	3,7	13,6	-	-	17,2
>180	9,0	10,0	10,0	9,0	-	-	19,0
Total	344,9	418,7	205,9	286,1	202,8	48,8	753,6

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

*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**	11	12	1057	1664	86	21	1182	1493	63	25	1148	1225
Otros***	12	11	986	857	21	86	927	932	25	63	851	809
Intragrupo	0	0	515	38	0	0	351	36	0	0	194	160
Total	23	23	2559	2559	106	106	2461	2461	88	88	2194	2194

* 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