

Fecha de Publicación: 8 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 04 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\$1326,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	257,8	269,2	179,2	252,8	90,0	5,0	527,0
15-35	239,7	464,4	331,7	115,7	80,8	72,0	652,1
36-60	31,6	14,4	14,4	31,6	-	-	46,1
61-90	4,4	1,6	1,6	4,4	-	-	6,0
91-180	16,6	4,8	4,8	16,6	-	-	21,4
>180	49,2	24,9	24,9	49,2	-	-	74,1
Total	599,3	779,3	556,6	470,3	170,8	77,0	1326,7

* 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	-	12,8 %	11,8 %	12,2 %
15-35	5,6 %	10,5 %	6,7 %	9,1 %
36-60	-	1,4 %	7,7 %	5,7 %
61-90	-	9,8 %	8,1 %	8,6 %
91-180	-	8,0 %	7,8 %	7,8 %
>180	-	7,9 %	7,0 %	7,3 %
Total	5,6 %	10,9 %	9,5 %	10,0 %

*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	1064	1668	87	23	1442	1995	63	26	1284	1222
Otros***	12	12	990	864	22	87	1201	1178	26	63	848	944
Intragrupo	0	0	515	38	1	0	571	41	0	0	194	160
Total	24	24	2569	2569	110	110	3214	3214	89	89	2325	2325

* 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