

Fecha de Publicación: 10 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 08 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\$1243,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	235,8	157,0	141,5	220,4	0,1	-	377,4
15-35	312,9	413,0	303,0	234,9	52,0	20,0	667,8
36-60	50,7	2,6	2,6	50,7	-	-	53,3
61-90	14,5	1,8	1,8	14,5	-	-	16,4
91-180	11,4	13,4	13,4	11,4	-	-	24,8
>180	103,1	1,0	1,0	103,1	-	-	104,1
Total	728,5	588,8	463,2	635,1	52,1	20,0	1243,9

* 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	22,7 %	25,3 %	-0,9 %	10,7 %
15-35	14,7 %	7,3 %	-2,1 %	4,3 %
36-60	-	5,5 %	7,0 %	6,9 %
61-90	-	2,7 %	6,7 %	6,3 %
91-180	-	8,2 %	8,6 %	8,4 %
>180	-	-	-	-
Total	16,3 %	11,9 %	1,1 %	6,5 %

*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	8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	88	24	1657	2246	66	32	1415	1395	51	34	1331	1394
Otros***	23	88	1321	1393	32	66	981	1035	34	51	992	935
Intragrupo	1	0	701	41	0	0	194	160	0	0	183	177
Total	113	113	3680	3680	98	98	2590	2590	85	85	2506	2506

* 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