

Fecha de Publicación: 12 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 10 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\$607,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 9,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	120,4	59,5	48,3	89,3	-	20,0	168,7
15-35	237,2	133,4	83,6	202,2	24,8	10,0	345,6
36-60	6,2	4,7	4,7	6,2	-	-	10,9
61-90	20,7	3,2	2,3	20,7	0,9	-	23,9
91-180	15,3	2,5	2,5	15,3	-	-	17,8
>180	19,8	20,5	20,5	19,8	-	-	40,3
Total	419,6	223,7	161,9	353,5	25,7	30,0	607,2

* 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	51,1 %	0,0 %	13,6 %	12,0 %
15-35	7,4 %	5,3 %	9,8 %	8,4 %
36-60	-	4,4 %	11,7 %	8,6 %
61-90	-	4,8 %	7,2 %	7,0 %
91-180	-	7,8 %	6,4 %	6,6 %
>180	-	-	-	-
Total	20,9 %	3,8 %	10,3 %	9,1 %

*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	25	1737	2279	78	33	1608	1715	51	35	1502	1587
Otros***	23	88	1355	1473	33	78	1190	1197	35	51	1165	1085
Intragrupo	1	0	701	41	0	0	294	180	0	0	183	177
Total	113	113	3793	3793	110	110	3091	3091	86	86	2849	2849

* 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