

Fecha de Publicación: 16 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 12 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\$684,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	153,6	256,2	108,2	146,0	148,0	7,6	409,8
15-35	107,0	71,6	56,6	61,1	12,0	42,9	175,6
36-60	34,8	9,6	9,6	34,8	-	-	44,4
61-90	2,2	27,6	27,6	2,2	-	-	29,8
91-180	8,7	9,5	9,5	8,7	-	-	18,3
>180	6,1	0,5	0,5	6,1	-	-	6,6
Total	312,4	375,1	212,1	258,9	160,0	50,5	684,5

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

*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**	89	25	1742	2284	78	36	1766	2145	51	35	1616	1635
Otros***	23	89	1360	1478	36	78	1312	1352	35	51	1213	1195
Intragrupo	1	0	701	41	0	0	602	182	0	0	183	182
Total	113	113	3803	3803	115	115	3680	3680	86	86	3012	3012

* 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