

Fecha de Publicación: 17 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 15 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\$391,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	50,3	73,4	73,2	50,1	-	-	123,5
15-35	93,2	97,2	55,2	71,5	30,0	9,6	178,3
36-60	19,5	0,3	0,3	19,5	-	-	19,8
61-90	3,3	2,8	2,8	3,3	-	-	6,1
91-180	25,3	5,8	5,8	25,3	-	-	31,1
>180	24,5	8,0	8,0	24,5	-	-	32,5
Total	216,0	187,5	145,3	194,1	30,0	9,6	391,3

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

*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	15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	81	37	1763	2154	51	35	1649	1698	58	18	1091	1102
Otros***	37	81	1320	1349	35	51	1275	1228	18	58	827	934
Intragrupo	0	0	602	182	0	0	183	182	0	0	206	89
Total	118	118	3685	3685	86	86	3108	3108	76	76	2125	2125

* 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