

Fecha de Publicación: 18 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 16 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\$676,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	162,9	130,8	90,3	77,7	-	44,8	253,2
15-35	120,7	274,1	224,1	70,7	-	-	344,8
36-60	8,9	2,8	2,8	8,9	-	-	11,6
61-90	20,2	1,4	1,4	20,2	-	-	21,5
91-180	16,9	0,6	0,6	16,9	-	-	17,5
>180	22,3	5,2	5,2	22,3	-	-	27,4
Total	351,8	414,7	324,3	216,6	-	44,8	676,1

* 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	-19,0 %	3,0 %	5,6 %	-0,3 %
15-35	5,9 %	5,9 %	4,7 %	5,6 %
36-60	-	5,7 %	4,9 %	5,1 %
61-90	-	7,7 %	4,3 %	4,5 %
91-180	-	9,2 %	4,9 %	5,1 %
>180	-	7,3 %	5,0 %	5,4 %
Total	-5,3 %	5,1 %	5,0 %	3,6 %

*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**	78	37	1780	2169	54	35	1755	1805	60	19	1141	1120
Otros***	37	78	1333	1363	35	54	1344	1252	19	60	845	983
Intragrupo	0	0	604	185	0	0	181	224	0	0	206	89
Total	115	115	3717	3717	89	89	3281	3281	78	78	2192	2192

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo