

Fecha de Publicación: 22 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 18 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\$1354,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	188,9	454,6	187,5	188,8	267,0	-	643,4
15-35	189,9	423,1	237,8	128,9	124,3	-	551,9
36-60	13,5	3,0	3,0	13,5	-	-	16,5
61-90	21,3	18,0	18,0	21,3	-	-	39,3
91-180	27,6	45,7	45,7	27,6	-	-	73,3
>180	20,2	13,1	10,1	17,2	-	-	30,3
Total	461,4	957,5	502,1	397,2	391,3	-	1354,8

* 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	53,3 %	7,0 %	-1,5 %	2,8 %
15-35	-3,6 %	8,9 %	3,1 %	5,4 %
36-60	-	11,3 %	7,3 %	8,0 %
61-90	-	4,5 %	8,5 %	6,7 %
91-180	-	7,3 %	7,4 %	7,3 %
>180	7,8 %	7,6 %	6,1 %	6,8 %
Total	-2,9 %	7,9 %	1,8 %	4,6 %

*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**	80	39	1781	2190	58	35	1967	2290	61	18	1249	1200
Otros***	39	79	1354	1364	35	58	1557	1463	18	61	925	1091
Intragrupo	0	0	604	185	0	0	453	224	0	0	206	89
Total	118	118	3739	3739	93	93	3976	3976	79	79	2380	2380

* 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