

Fecha de Publicación: 23 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 19 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\$840,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	197,0	207,1	206,7	144,3	-	52,4	403,8
15-35	215,0	140,9	85,6	153,0	23,4	30,0	323,9
36-60	3,2	19,0	18,9	3,1	-	-	22,1
61-90	7,7	48,4	48,4	7,6	-	-	56,0
91-180	14,3	14,0	14,0	14,3	-	-	28,3
>180	4,6	1,5	1,5	4,6	-	-	6,0
Total	441,8	430,9	375,0	326,9	23,4	82,4	840,2

* 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	-16,3 %	-4,6 %	4,4 %	-0,7 %
15-35	6,8 %	10,4 %	12,3 %	11,1 %
36-60	1,3 %	5,0 %	7,2 %	5,3 %
61-90	3,5 %	6,9 %	8,9 %	7,1 %
91-180	-	6,7 %	4,6 %	5,6 %
>180	-	6,1 %	6,8 %	6,6 %
Total	6,6 %	1,5 %	8,3 %	4,9 %

*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	1790	2189	58	36	2105	2388	61	19	1301	1307
Otros***	39	79	1354	1373	36	58	1655	1556	19	61	1032	1135
Intragrupo	0	0	604	185	0	0	453	269	0	0	206	96
Total	119	119	3748	3748	94	94	4213	4213	80	80	2539	2539

* 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