

Fecha de Publicación: 24 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 22 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\$475,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	134,2	194,7	94,7	114,2	80,0	-	308,9
15-35	97,6	52,4	41,4	86,6	-	-	139,0
36-60	4,8	0,5	0,5	4,8	-	-	5,3
61-90	3,0	2,1	2,1	3,0	-	-	5,1
91-180	9,2	3,2	3,2	9,2	-	-	12,5
>180	4,2	0,9	0,9	4,2	-	-	5,1
Total	253,1	253,8	142,8	222,1	80,0	-	475,9

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

*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	22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	58	36	2173	2507	61	19	1367	1369	36	19	1072	1528
Otros***	36	58	1694	1624	19	61	1074	1181	19	36	1093	836
Intragrupo	0	0	533	269	0	0	206	96	0	0	305	107
Total	94	94	4400	4400	80	80	2647	2647	55	55	2471	2471

* 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