

Fecha de Publicación: 25 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 23 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\$627,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de -7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	235,7	65,1	44,6	175,2	-	40,0	280,2
15-35	115,3	208,6	174,4	81,1	-	-	289,7
36-60	7,6	1,9	1,9	7,6	-	-	9,5
61-90	9,3	1,8	1,8	9,3	-	-	11,0
91-180	1,3	11,0	11,0	1,3	-	-	12,3
>180	4,2	20,2	20,2	4,2	-	-	24,4
Total	373,3	308,5	253,9	278,6	-	40,0	627,2

* 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	40,2 %	-51,6 %	-31,6 %	-26,3 %
15-35	2,2 %	2,2 %	1,1 %	1,9 %
36-60	-	9,2 %	9,5 %	9,4 %
61-90	-	10,9 %	6,3 %	7,0 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	6,6 %	6,5 %	6,6 %
Total	16,4 %	-3,1 %	-16,6 %	-7,1 %

*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**	59	36	2305	2545	60	21	1431	1374	36	20	1131	1588
Otros***	36	59	1732	1716	21	60	1079	1245	20	36	1133	875
Intragrupo	0	0	533	309	0	0	206	96	0	0	305	107
Total	95	95	4570	4570	81	81	2716	2716	56	56	2569	2569

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo