

Fecha de Publicación: 26 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 24 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\$575,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	146,8	218,3	213,3	146,8	5,0	-	365,1
15-35	88,6	69,8	56,6	84,4	10,0	1,0	155,2
36-60	15,8	1,0	1,0	15,8	-	-	16,9
61-90	6,7	4,2	4,2	6,7	-	-	10,9
91-180	3,4	15,7	15,7	3,4	-	-	19,1
>180	8,0	0,0	0,0	8,0	-	-	8,0
Total	269,3	309,0	290,8	265,1	15,0	1,0	575,2

* 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	-	10,0 %	4,0 %	7,8 %
15-35	5,8 %	12,7 %	0,8 %	5,6 %
36-60	-	12,0 %	16,8 %	16,6 %
61-90	-	5,5 %	43,6 %	29,1 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	-	4,7 %	4,7 %
Total	5,8 %	10,0 %	5,2 %	7,7 %

*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**	56	36	2308	2546	64	22	1501	1487	37	20	1195	1693
Otros***	36	56	1733	1719	22	64	1191	1316	20	37	1233	939
Intragrupo	0	0	533	309	0	0	206	96	0	0	310	107
Total	93	93	4575	4575	86	86	2899	2899	57	57	2739	2739

* 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