

Fecha de Publicación: 29 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 25 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\$1166,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	202,3	510,1	140,3	134,4	304,0	2,1	646,6
15-35	247,6	215,6	158,4	229,6	39,2	-	445,2
36-60	8,2	1,2	1,2	8,2	-	-	9,4
61-90	6,7	7,2	7,2	6,7	-	-	13,9
91-180	3,3	6,2	6,2	3,3	-	-	9,5
>180	9,2	32,5	32,5	9,2	-	-	41,7
Total	477,3	772,8	345,9	391,3	343,2	2,1	1166,3

* 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	3,2 %	10,4 %	-17,4 %	-4,3 %
15-35	28,0 %	6,4 %	11,8 %	10,4 %
36-60	-	8,5 %	17,4 %	16,2 %
61-90	-	11,9 %	5,0 %	8,6 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	6,5 %	6,4 %	6,5 %
Total	8,6 %	7,7 %	2,3 %	5,1 %

*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**	56	36	2307	2546	66	23	1623	1911	37	20	1282	1785
Otros***	36	56	1733	1718	23	65	1286	1410	20	37	1280	981
Intragrupo	0	0	533	309	0	1	510	98	0	0	310	107
Total	92	92	4573	4573	89	89	3419	3419	57	57	2873	2873

* 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