

Fecha de Publicación: 1 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 29 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\$606,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	134,2	62,9	52,9	124,2	-	-	187,1
15-35	204,0	191,2	120,0	124,8	1,0	9,0	325,0
36-60	18,8	1,8	1,8	18,8	-	-	20,6
61-90	6,8	0,0	0,0	6,8	-	-	6,8
91-180	27,2	0,5	0,5	27,2	-	-	27,7
>180	26,3	12,9	12,9	26,3	-	-	39,1
Total	417,3	269,3	188,1	328,0	1,0	9,0	606,4

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

*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	29 de Sep. al 3 de Octubre				6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	24	1789	1938	57	20	1454	1845	42	26	674	1092
Otros***	24	66	1312	1492	20	57	1330	1142	26	42	752	501
Intragrupo	0	1	510	181	0	0	310	107	0	0	210	43
Total	91	91	3611	3611	78	78	3094	3094	67	67	1636	1636

* 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