

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