

Fecha de Publicación: 3 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 01 de Octubre 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\$491,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 13,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	127,9	52,4	41,9	54,5	10,4	73,4	180,2
15-35	126,7	201,7	162,2	82,2	10,0	15,0	298,9
36-60	4,4	0,1	0,1	4,4	-	-	4,5
61-90	1,9	0,2	0,2	1,9	-	-	2,2
91-180	2,6	3,0	3,0	2,6	-	-	5,6
>180	0,1	0,0	0,0	0,1	-	-	0,1
Total	263,6	257,5	207,5	145,7	20,4	88,4	491,5

* 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	-	32,9 %	24,5 %	29,0 %
15-35	5,7 %	9,8 %	12,0 %	10,0 %
36-60	-	6,4 %	3,0 %	3,1 %
61-90	-	5,7 %	-0,8 %	0,0 %
91-180	-	-	-	-
>180	-	-	5,8 %	5,8 %
Total	5,7 %	14,3 %	14,8 %	13,8 %

*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	23	1793	1957	58	21	1666	1940	56	28	769	1132
Otros***	23	66	1331	1497	21	58	1415	1250	28	56	793	587
Intragrupo	0	1	510	181	0	0	321	211	0	0	210	51
Total	90	90	3634	3634	79	79	3402	3402	84	84	1771	1771

* 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