

Fecha de Publicación: 6 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 02 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\$704,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	117,5	128,1	60,8	117,3	67,0	-	245,4
15-35	88,8	301,3	211,7	87,8	88,6	-	389,1
36-60	12,7	8,0	2,5	7,7	5,5	5,0	20,7
61-90	8,2	0,0	0,0	8,2	-	-	8,2
91-180	9,0	0,1	0,1	9,0	-	-	9,1
>180	15,7	16,0	16,0	15,7	-	-	31,7
Total	252,0	453,5	291,2	245,7	161,1	5,0	704,2

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

*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**	66	23	1797	1958	58	21	1715	2057	58	28	846	1144
Otros***	23	65	1332	1500	21	58	1475	1299	28	58	794	665
Intragrupo	0	1	510	181	0	0	378	211	0	0	220	51
Total	89	89	3639	3639	79	79	3568	3568	86	86	1860	1860

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo