

Fecha de Publicación: 8 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 06 de Octubre de 2008¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$701,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	98,6	203,0	198,0	93,6	-	-	296,6
15-35	103,0	201,6	162,6	64,6	5,0	4,4	270,7
36-60	4,0	10,5	10,5	4,0	-	-	14,5
61-90	11,6	5,1	5,1	11,6	-	-	16,7
91-180	17,5	32,4	32,4	17,5	-	-	49,9
>180	10,3	43,0	43,0	10,3	-	-	53,3
Total	245,0	495,7	451,6	201,5	5,0	4,4	701,6

* 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	-32,0 %	0,5 %	-3,0 %	-0,4 %
15-35	9,2 %	7,6 %	3,0 %	6,7 %
36-60	-	14,1 %	1,9 %	10,7 %
61-90	-	7,6 %	4,3 %	5,3 %
91-180	-	7,7 %	5,3 %	6,8 %
>180	-	6,4 %	4,4 %	6,0 %
Total	9,1 %	4,5 %	1,2 %	3,9 %

*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	6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	58	21	1807	2346	63	28	961	1271	76	112	722	947
Otros***	21	58	1619	1386	28	63	921	779	112	76	742	566
Intragrupo	0	0	518	211	0	0	220	51	0	0	95	46
Total	79	79	3943	3943	92	92	2102	2102	188	188	1559	1559

* 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