

Fecha de Publicación: 14 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 09 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\$924,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	199,3	202,8	46,2	190,2	155,8	8,3	401,3
15-35	192,2	235,2	165,6	136,8	21,6	7,4	379,4
36-60	20,0	16,4	16,4	20,0	-	-	36,3
61-90	8,5	4,0	4,0	8,5	-	-	12,5
91-180	8,0	12,2	9,2	5,0	-	-	17,2
>180	35,0	47,6	42,6	30,0	-	-	77,6
Total	462,9	518,2	284,0	390,4	177,4	15,7	924,3

* 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	47,2 %	-0,8 %	7,4 %	5,7 %
15-35	1,2 %	8,2 %	2,5 %	5,0 %
36-60	-	5,0 %	2,4 %	3,6 %
61-90	-	6,9 %	5,8 %	6,2 %
91-180	5,7 %	9,1 %	6,4 %	7,7 %
>180	5,8 %	6,2 %	5,1 %	5,7 %
Total	2,5 %	6,2 %	5,0 %	5,3 %

*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	27	1886	2384	63	33	1166	1514	76	113	923	1121
Otros***	27	58	1627	1445	33	63	1007	944	113	76	849	714
Intragrupo	0	0	548	231	0	0	376	91	0	0	112	48
Total	85	85	4061	4061	97	97	2549	2549	188	188	1884	1884

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