

Fecha de Publicación: 15 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 10 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\$403,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	68,5	113,4	33,4	63,5	75,0	-	176,8
15-35	26,0	155,7	149,7	26,0	6,0	-	181,7
36-60	4,9	6,0	6,0	4,9	-	-	10,9
61-90	4,5	1,5	1,5	4,5	-	-	5,9
91-180	6,7	13,0	13,0	6,7	-	-	19,7
>180	8,6	0,0	0,0	8,6	-	-	8,6
Total	119,1	289,6	203,6	114,1	81,0	-	403,7

* 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	7,5 %	12,9 %	-0,8 %	4,1 %
15-35	-	3,1 %	-0,7 %	2,5 %
36-60	-	6,0 %	11,9 %	8,6 %
61-90	-	6,6 %	5,4 %	5,7 %
91-180	-	6,4 %	5,3 %	6,0 %
>180	-	-	6,0 %	6,0 %
Total	7,5 %	5,0 %	0,9 %	3,6 %

*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	64	34	1206	1601	76	113	950	1147
Otros***	27	58	1627	1445	34	64	1019	985	113	76	870	737
Intragrupo	0	0	548	231	0	0	451	91	0	0	112	48
Total	85	85	4061	4061	98	98	2676	2676	189	189	1932	1932

* 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