

Fecha de Publicación: 16 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 14 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\$245,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	76,0	33,2	10,8	63,8	10,3	-	97,1
15-35	55,9	35,1	30,1	55,9	5,0	-	91,0
36-60	3,8	29,2	21,6	3,8	7,5	-	33,0
61-90	5,6	2,8	2,8	5,6	-	-	8,4
91-180	2,9	4,5	4,4	2,8	-	-	7,3
>180	8,2	0,0	0,0	8,2	-	-	8,2
Total	152,4	104,9	69,8	140,2	22,8	-	245,0

* 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	42,0 %	28,6 %	1,0 %	10,7 %
15-35	-	15,0 %	3,7 %	7,7 %
36-60	5,7 %	11,6 %	1,7 %	10,1 %
61-90	-	-7,0 %	-3,8 %	-4,9 %
91-180	6,5 %	6,0 %	0,8 %	4,0 %
>180	-	9,0 %	7,4 %	7,4 %
Total	41,5 %	13,2 %	2,4 %	8,3 %

*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	13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	65	35	1231	1618	75	113	997	1162	50	38	934	1233
Otros***	34	65	1027	1010	113	75	873	771	38	49	857	706
Intragrupo	0	0	461	91	0	0	112	48	0	0	171	24
Total	100	100	2718	2718	188	188	1982	1982	87	87	1963	1963

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