

Fecha de Publicación: 20 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 16 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\$745,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,3	103,4	65,9	112,8	37,0	-	216,2
15-35	158,3	312,7	189,2	138,2	103,5	-	451,0
36-60	12,0	31,9	14,9	0,0	5,0	-	32,0
61-90	1,5	1,3	1,3	1,5	-	-	2,8
91-180	0,1	33,0	33,0	0,1	-	-	33,0
>180	6,0	4,4	4,4	6,0	-	-	10,4
Total	291,3	486,6	308,6	258,7	145,5	-	745,4

* 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	39,5 %	0,9 %	5,8 %	4,0 %
15-35	7,6 %	7,8 %	2,1 %	5,5 %
36-60	9,1 %	7,2 %	5,2 %	8,0 %
61-90	-	5,3 %	3,7 %	4,4 %
91-180	-	9,4 %	3,0 %	9,4 %
>180	-	7,0 %	6,2 %	6,5 %
Total	8,6 %	6,4 %	3,7 %	5,4 %

*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**	64	36	1231	1616	76	119	1180	1486	50	41	1011	1304
Otros***	36	64	1025	1010	119	76	1010	948	41	50	921	782
Intragrupo	0	0	461	91	0	0	292	48	0	0	178	24
Total	100	100	2717	2717	195	195	2482	2482	91	91	2110	2110

* 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