

Fecha de Publicación: 24 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 22 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\$560,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,7	135,4	95,0	43,0	40,0	4,3	182,7
15-35	166,9	208,0	132,0	126,9	36,0	-	334,9
36-60	4,1	2,2	0,6	2,5	-	-	4,7
61-90	4,4	0,0	0,0	4,4	-	-	4,4
91-180	10,9	0,5	0,5	10,4	-	0,5	11,4
>180	12,6	10,0	10,0	12,6	-	-	22,6
Total	246,6	356,1	238,1	199,9	76,0	4,7	560,8

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

*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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	77	126	1383	1589	50	42	1207	1519	11	27	520	860
Otros***	126	77	1048	1101	42	50	1062	955	27	11	644	410
Intragrupo	0	0	347	88	0	0	233	28	0	0	127	20
Total	203	203	2778	2778	92	92	2502	2502	38	38	1291	1291

* 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