

Fecha de Publicación: 9 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 05 de Septiembre de 2008 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$844,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	119,8	293,7	133,3	89,4	130,0	-	383,1
15-35	196,8	189,8	142,5	154,6	32,0	26,9	371,3
36-60	27,9	10,7	10,7	27,9	-	-	38,6
61-90	5,3	2,9	2,9	5,3	-	-	8,3
91-180	11,9	9,4	9,4	11,9	-	-	21,4
>180	10,3	17,0	12,0	5,3	-	-	22,3
Total	372,0	523,6	310,9	294,5	162,0	26,9	844,9

* 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	26,9 %	8,4 %	23,9 %	16,1 %
15-35	10,1 %	7,5 %	6,8 %	7,3 %
36-60	-	11,2 %	6,1 %	7,5 %
61-90	-	9,6 %	7,6 %	8,3 %
91-180	-	8,7 %	6,7 %	7,6 %
>180	7,4 %	7,5 %	6,9 %	7,4 %
Total	19,9 %	8,1 %	11,9 %	10,7 %

*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	1 al 5 de Septiembre				8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	12	1064	1668	88	24	1519	2199	66	27	1323	1310
Otros***	12	12	990	864	23	88	1275	1254	26	65	906	954
Intragrupo	0	0	515	38	1	0	701	41	0	0	194	160
Total	24	24	2569	2569	112	112	3495	3495	92	92	2423	2423

* 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) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo