

Fecha de Publicación: 11 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 09 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\$1053,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 12,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	213,8	312,4	211,9	213,3	100,0	-	525,7
15-35	142,1	312,9	246,8	121,2	53,0	7,8	441,9
36-60	19,7	6,9	6,9	19,7	-	-	26,6
61-90	2,7	8,2	8,2	2,7	-	-	10,8
91-180	10,9	3,5	3,5	10,9	-	-	14,3
>180	24,1	10,6	10,6	24,1	-	-	34,7
Total	413,1	654,4	487,8	391,8	153,0	7,8	1053,9

* 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	-5,2 %	24,2 %	10,3 %	18,7 %
15-35	8,5 %	7,2 %	7,2 %	7,2 %
36-60	-	7,3 %	2,8 %	4,0 %
61-90	-	7,9 %	6,7 %	7,6 %
91-180	-	6,9 %	6,7 %	6,7 %
>180	-	-	-	-
Total	8,0 %	14,6 %	8,2 %	12,0 %

*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

Sectores	8 al 12 de Septiembre				15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	88	24	1734	2268	66	33	1526	1664	51	35	1397	1540
Otros***	23	88	1343	1470	32	66	1150	1146	35	51	1138	1001
Intragrupo	1	0	701	41	0	0	294	160	0	0	183	177
Total	113	113	3779	3779	98	98	2970	2970	86	86	2718	2718

* 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