

Fecha de Publicación: 19 de Septiembre de 2008
Fecha de Información: 17 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\$632,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	87,8	79,9	74,8	87,8	5,0	-	167,6
15-35	130,5	293,4	214,7	97,8	46,0	-	391,2
36-60	14,1	11,7	5,7	8,1	-	-	19,8
61-90	13,0	16,4	16,4	13,0	-	-	29,4
91-180	5,3	0,3	0,3	5,3	-	-	5,7
>180	9,0	10,0	10,0	9,0	-	-	19,0
Total	259,8	411,7	322,0	221,1	51,0	-	632,8

* 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	24,2 %	-8,7 %	7,0 %	0,5 %
15-35	7,1 %	5,4 %	6,3 %	5,8 %
36-60	-1,5 %	7,7 %	5,7 %	4,1 %
61-90	-	8,4 %	6,5 %	7,6 %
91-180	-	11,4 %	5,5 %	5,8 %
>180	-	7,1 %	5,9 %	6,5 %
Total	5,8 %	2,8 %	6,5 %	4,5 %

*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	15 al 19 de Septiembre				22 al 26 de Septiembre				29 de Sep. al 3 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	79	38	1780	2190	56	35	1817	1874	61	19	1193	1161
Otros***	38	79	1354	1363	35	56	1408	1314	19	61	886	1035
Intragrupo	0	0	604	185	0	0	186	224	0	0	206	89
Total	117	117	3738	3738	91	91	3412	3412	80	80	2285	2285

* 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