

Fecha de Publicación: 10 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 08 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\$584,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	130,1	193,0	143,0	64,1	-	16,0	273,1
15-35	24,4	176,4	127,0	24,4	49,3	-	200,8
36-60	45,4	6,9	6,9	45,4	-	-	52,4
61-90	1,5	8,1	8,1	1,5	-	-	9,6
91-180	5,9	22,0	22,0	5,9	-	-	27,9
>180	10,3	10,7	10,7	10,3	-	-	21,0
Total	217,7	417,0	317,7	151,7	49,3	16,0	584,7

* 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	6,8 %	10,4 %	12,8 %	10,3 %
15-35	-	-1,7 %	3,1 %	-0,9 %
36-60	-	10,3 %	-0,1 %	1,3 %
61-90	-	7,6 %	5,7 %	7,3 %
91-180	-	6,1 %	4,7 %	5,8 %
>180	-	6,3 %	5,7 %	6,0 %
Total	6,8 %	5,0 %	6,5 %	5,6 %

*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	6 al 10 de Octubre				13 al 17 de Octubre				20 al 24 de Octubre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	58	23	1887	2386	63	29	1080	1318	76	112	807	1119
Otros***	23	58	1629	1446	29	63	968	868	112	76	847	599
Intragrupo	0	0	548	231	0	0	220	82	0	0	112	48
Total	81	81	4064	4064	92	92	2268	2268	188	188	1766	1766

* 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