

Fecha de Publicación: 31 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 29 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\$621,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	215,0	93,2	78,1	120,0	-	80,0	293,2
15-35	176,6	81,2	60,2	135,6	-	20,0	236,8
36-60	1,5	28,4	28,4	1,5	-	-	30,0
61-90	19,6	32,2	20,2	7,6	-	-	39,8
91-180	3,3	6,6	6,6	3,3	-	-	9,9
>180	11,2	0,9	0,9	11,2	-	-	12,1
Total	427,3	242,6	194,5	279,2	-	100,0	621,8

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

*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	27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	56	47	1507	1683	13	29	890	1045	85	27	773	986
Otros***	46	56	1215	1215	29	13	779	680	27	85	726	555
Intragrupo	0	0	245	68	0	0	137	80	0	0	152	111
Total	102	102	2967	2967	42	42	1806	1806	112	112	1651	1651

* 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