

Fecha de Publicación: 5 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 31 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\$501,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	106,4	98,9	56,9	46,4	12,0	30,0	175,3
15-35	114,0	104,8	78,3	99,5	23,5	11,5	215,7
36-60	21,0	22,0	11,5	21,0	10,5	-	43,0
61-90	2,5	0,7	0,7	2,5	-	-	3,1
91-180	4,4	7,3	7,3	4,4	-	-	11,6
>180	6,0	47,0	47,0	6,0	-	-	53,0
Total	254,2	280,7	201,6	179,6	46,0	41,5	501,8

* 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	-0,9 %	9,2 %	5,8 %	5,8 %
15-35	14,2 %	7,9 %	3,5 %	5,6 %
36-60	-	6,2 %	5,7 %	5,9 %
61-90	-	5,4 %	6,3 %	6,1 %
91-180	-	7,2 %	5,6 %	6,6 %
>180	-	6,8 %	5,4 %	6,6 %
Total	0,5 %	7,9 %	4,5 %	5,8 %

*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

Sectores	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	1506	1685	13	31	1071	1249	104	32	884	1060
Otros***	47	55	1216	1214	30	13	851	800	32	104	788	666
Intragrupo	0	0	245	68	0	0	237	110	0	0	164	111
Total	102	102	2966	2966	44	44	2159	2159	136	136	1837	1837

* 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