

Fecha de Publicación: 7 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 05 de Noviembre 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\$621,6 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	156,3	194,1	122,0	134,3	50,1	-	328,4
15-35	138,5	81,3	79,3	138,5	2,0	-	219,8
36-60	26,2	9,6	6,6	26,2	3,0	-	35,8
61-90	2,3	14,0	14,0	2,3	-	-	16,3
91-180	3,4	17,1	17,1	3,4	-	-	20,5
>180	0,6	0,0	0,0	0,6	-	-	0,7
Total	327,4	316,2	239,1	305,4	55,1	-	621,6

* 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	35,5 %	0,0 %	4,2 %	5,2 %
15-35	-	6,8 %	5,4 %	5,9 %
36-60	-	2,7 %	8,3 %	7,2 %
61-90	-	6,3 %	1,5 %	5,6 %
91-180	-	6,0 %	2,7 %	5,4 %
>180	-	7,9 %	4,0 %	4,3 %
Total	35,5 %	3,4 %	5,0 %	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	3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	31	1128	1272	105	34	1065	1243	37	25	597	1018
Otros***	30	13	874	827	34	105	900	824	25	37	746	490
Intragrupo	0	0	237	140	0	0	214	111	0	0	182	15
Total	44	44	2239	2239	140	140	2178	2178	62	62	1524	1524

* 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