

Fecha de Publicación: 12 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 10 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\$518,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	129,6	76,3	47,3	103,6	17,0	14,0	193,9
15-35	137,7	105,5	80,4	114,6	5,0	3,0	223,1
36-60	28,1	10,7	10,7	28,1	-	-	38,8
61-90	1,7	17,6	17,6	1,7	-	-	19,4
91-180	2,8	6,2	6,0	2,7	-	-	8,8
>180	11,1	33,6	23,5	1,0	-	-	34,6
Total	311,0	249,9	185,7	251,7	22,0	17,0	518,6

* 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	-15,5 %	20,5 %	-9,0 %	-0,6 %
15-35	7,1 %	8,8 %	10,0 %	9,3 %
36-60	-	7,2 %	4,5 %	5,2 %
61-90	-	5,1 %	7,7 %	5,3 %
91-180	3,5 %	6,3 %	9,6 %	7,3 %
>180	6,2 %	9,4 %	4,1 %	8,3 %
Total	0,5 %	11,3 %	1,8 %	5,4 %

*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	10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre				24 al 28 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	106	38	1307	1414	38	28	769	1129	40	32	953	1013
Otros***	38	106	1012	1029	28	38	804	625	32	40	874	829
Intragrupo	0	0	249	125	0	0	197	15	0	0	73	58
Total	145	145	2568	2568	66	66	1769	1769	71	71	1899	1899

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo