

Fecha de Publicación: 13 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 11 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\$178,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	51,0	41,8	41,7	50,9	-	-	92,7
15-35	40,0	32,4	29,4	37,0	-	-	69,5
36-60	11,0	0,1	0,1	11,0	-	-	11,1
61-90	0,5	0,9	0,9	0,5	-	-	1,4
91-180	0,9	0,4	0,4	0,9	-	-	1,3
>180	2,2	0,0	0,0	2,2	-	-	2,2
Total	105,6	75,7	72,6	102,5	-	-	178,2

* 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	32,6 %	7,8 %	-2,6 %	2,1 %
15-35	8,3 %	15,9 %	13,0 %	14,0 %
36-60	-	8,2 %	5,2 %	5,2 %
61-90	-	7,2 %	5,4 %	6,6 %
91-180	-	8,5 %	6,7 %	7,3 %
>180	-	7,4 %	6,1 %	6,1 %
Total	9,1 %	11,1 %	4,2 %	7,1 %

*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	40	1315	1413	45	28	800	1148	40	32	974	1054
Otros***	39	106	1011	1037	28	45	823	657	32	40	915	850
Intragrupo	0	0	249	125	0	0	197	15	0	0	73	58
Total	146	146	2575	2575	73	73	1820	1820	72	72	1961	1961

* 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