

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