

Fecha de Publicación: 22 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 20 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\$403,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	81,3	126,2	38,1	63,3	70,0	-	189,5
15-35	85,9	95,6	89,6	79,9	-	-	175,5
36-60	2,0	14,7	13,5	2,0	1,2	-	16,7
61-90	0,7	3,8	3,8	0,7	-	-	4,4
91-180	3,8	11,6	10,5	3,8	1,1	-	15,4
>180	2,0	0,2	0,2	2,0	-	-	2,2
Total	175,8	252,1	155,7	151,8	72,4	-	403,8

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

*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	20 al 24 de Octubre				27 al 31 de Octubre				3 al 7 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	76	125	1308	1567	50	41	1091	1382	10	27	418	789
Otros***	125	76	1036	1076	41	50	966	844	27	9	593	340
Intragrupo	0	0	347	48	0	0	193	24	0	0	127	8
Total	201	201	2692	2692	91	91	2250	2250	37	37	1138	1138

* 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