

Fecha de Publicación: 23 de Octubre de 2008
Fecha de Información: 21 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\$455,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	161,2	42,7	32,3	104,2	-	46,6	193,5
15-35	83,8	153,1	114,9	53,4	18,1	10,4	216,9
36-60	2,9	0,4	0,4	2,9	-	-	3,3
61-90	1,4	0,5	0,5	1,4	-	-	1,9
91-180	2,1	24,1	24,1	2,1	-	-	26,2
>180	0,3	13,9	13,9	0,3	-	-	14,1
Total	251,6	234,7	186,2	164,2	18,1	57,0	455,9

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

*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	1380	1587	50	41	1170	1405	10	27	450	819
Otros***	125	76	1046	1097	41	50	989	923	27	9	613	351
Intragrupo	0	0	347	88	0	0	193	24	0	0	127	20
Total	202	202	2772	2772	91	91	2352	2352	37	37	1190	1190

* 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