

Fecha de Publicación: 6 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 04 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\$402,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	112,4	54,5	54,3	82,3	0,2	30,0	166,8
15-35	109,3	116,8	88,8	85,3	6,0	2,0	204,1
36-60	5,1	5,9	5,9	5,1	-	-	11,0
61-90	1,5	4,7	4,7	1,5	-	-	6,2
91-180	0,1	13,6	13,6	0,1	-	-	13,7
>180	0,0	0,6	0,6	0,0	-	-	0,6
Total	228,3	196,2	168,0	174,3	6,2	32,0	402,5

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

*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	3 al 7 de Noviembre				10 al 14 de Noviembre				17 al 21 de Noviembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	32	1128	1270	105	33	920	1071	37	24	546	993
Otros***	31	13	872	827	33	105	800	701	24	37	721	439
Intragrupo	0	0	237	140	0	0	164	111	0	0	182	15
Total	45	45	2238	2238	138	138	1883	1883	61	61	1448	1448

* 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