

Fecha de Publicación: 19 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 14 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\$511,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	139,8	72,7	44,6	139,7	28,0	-	212,4
15-35	91,6	135,7	121,7	80,6	3,0	-	216,3
36-60	17,4	3,7	3,7	17,4	-	-	21,1
61-90	0,0	3,2	3,2	0,0	-	-	3,2
91-180	0,0	6,8	6,8	0,0	-	-	6,8
>180	8,1	43,1	43,1	8,1	-	-	51,1
Total	256,9	265,1	223,0	245,8	31,0	-	511,0

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

*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	1412	48	40	1006	1278	81	32	1140	1176
Otros***	40	106	1010	1038	40	48	913	862	32	81	969	1016
Intragrupo	0	0	249	125	0	0	237	15	0	0	141	58
Total	146	146	2575	2575	88	88	2155	2155	113	113	2249	2249

* 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