

Fecha de Publicación: 20 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 18 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\$509,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	124,5	58,5	38,4	84,4	-	20,0	162,9
15-35	127,3	155,1	150,1	121,3	-	1,0	277,4
36-60	7,5	10,1	5,1	2,5	-	-	12,5
61-90	2,3	0,1	0,1	2,3	-	-	2,4
91-180	1,2	12,2	12,2	1,2	-	-	13,3
>180	0,3	40,4	40,4	0,3	-	-	40,7
Total	263,1	276,3	246,2	212,0	-	21,0	509,3

* 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	20,9 %	18,1 %	6,3 %	11,5 %
15-35	6,3 %	8,7 %	5,7 %	7,3 %
36-60	7,0 %	7,0 %	4,8 %	6,6 %
61-90	-	7,3 %	6,9 %	6,9 %
91-180	-	6,6 %	7,0 %	6,7 %
>180	-	7,0 %	4,9 %	7,0 %
Total	16,2 %	9,7 %	5,9 %	8,5 %

*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	17 al 21 de Noviembre				24 al 28 de Noviembre				1 al 5 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	49	40	1049	1287	81	32	1196	1217	18	13	643	947
Otros***	40	49	922	886	32	81	998	1052	13	18	624	508
Intragrupo	0	0	237	35	0	0	133	58	0	0	208	21
Total	89	89	2208	2208	113	113	2327	2327	31	31	1475	1475

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo