

Fecha de Publicación: 21 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 19 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\$645,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	112,2	207,0	116,9	57,2	35,0	-	264,1
15-35	138,6	213,2	95,7	82,6	61,5	-	295,8
36-60	7,5	0,5	0,5	7,5	-	-	8,0
61-90	13,6	0,8	0,8	13,6	-	-	14,4
91-180	34,2	21,8	11,8	21,2	-	3,0	46,0
>180	17,0	0,0	0,0	17,0	-	-	17,0
Total	323,2	443,2	225,6	199,1	96,5	3,0	645,3

* 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	3,3 %	10,1 %	12,6 %	9,1 %
15-35	3,3 %	11,2 %	8,5 %	8,4 %
36-60	-	7,0 %	5,8 %	5,9 %
61-90	-	7,3 %	7,0 %	7,0 %
91-180	7,3 %	7,8 %	7,2 %	7,4 %
>180	-	-	6,0 %	6,0 %
Total	3,6 %	10,4 %	9,1 %	8,4 %

*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	41	1049	1287	84	31	1261	1340	18	13	695	1060
Otros***	41	49	922	886	31	84	1061	1092	13	18	707	530
Intragrupo	0	0	237	35	0	0	168	58	0	0	208	21
Total	90	90	2208	2208	115	115	2490	2490	31	31	1610	1610

* 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