

Fecha de Publicación: 24 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 20 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\$807,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 140,5 | 174,7 | 113,1 | 138,9 | 60,0 | - | 313,6 |
| 15-35 | 112,0 | 287,6 | 255,1 | 103,5 | 24,5 | 0,5 | 391,6 |
| 36-60 | 4,0 | 9,2 | 9,2 | 4,0 | - | - | 13,2 |
| 61-90 | 3,2 | 1,0 | 1,0 | 3,2 | - | - | 4,2 |
| 91-180 | 0,2 | 44,6 | 44,6 | 0,2 | - | - | 44,8 |
| >180 | 0,2 | 40,0 | 40,0 | 0,2 | - | - | 40,2 |
| Total | 260,1 | 557,1 | 463,0 | 250,0 | 84,5 | 0,5 | 807,6 |

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

*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 | 38 | 1049 | 1290 | 86 | 32 | 1342 | 1512 | 18 | 13 | 767 | 1061 |
| Otros*** | 38 | 49 | 925 | 885 | 32 | 86 | 1171 | 1171 | 13 | 18 | 708 | 602 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 237 | 35 | 0 | 0 | 228 | 58 | 0 | 0 | 208 | 21 |
| Total | 87 | 87 | 2211 | 2211 | 117 | 117 | 2741 | 2741 | 32 | 32 | 1683 | 1683 |

* 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