

Fecha de Publicación: 25 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 21 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\$643,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	237,0	99,3	63,4	206,1	5,0	-	305,4
15-35	121,7	86,3	35,8	106,7	35,5	-	193,0
36-60	26,6	0,1	0,1	26,6	-	-	26,7
61-90	15,0	0,0	0,0	0,0	-	15,0	15,0
91-180	0,0	58,1	43,1	0,0	15,0	-	58,1
>180	0,5	45,0	45,0	0,5	-	-	45,5
Total	400,8	288,9	187,4	339,8	55,5	15,0	643,7

* 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	3,6 %	13,3 %	2,0 %	4,5 %
15-35	4,0 %	6,6 %	7,8 %	7,1 %
36-60	-	9,9 %	6,9 %	6,9 %
61-90	-	7,9 %	4,0 %	6,0 %
91-180	-	8,6 %	-	8,6 %
>180	-	7,8 %	7,0 %	7,8 %
Total	3,7 %	9,6 %	4,2 %	5,9 %

*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

Sectores	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	1040	1290	157	32	1401	1539	44	14	847	1132
Otros***	38	49	925	876	32	157	1192	1225	14	44	750	657
Intragrupo	0	0	237	35	0	0	228	58	0	0	213	21
Total	88	88	2201	2201	189	189	2821	2821	59	59	1810	1810

* 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