

Fecha de Publicación: 27 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 25 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\$730,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	197,2	153,3	115,2	186,2	27,0	-	339,5
15-35	127,7	149,9	118,5	122,3	28,1	2,1	274,3
36-60	57,0	15,0	5,0	47,0	-	-	62,0
61-90	0,9	9,1	9,1	0,9	-	-	10,0
91-180	6,8	10,5	10,5	6,8	-	-	17,3
>180	6,6	23,0	20,5	4,1	-	-	27,1
Total	396,2	360,9	278,9	367,2	55,1	2,1	730,2

* 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	30,9 %	-20,0 %	-2,0 %	-7,5 %
15-35	1,8 %	13,7 %	4,7 %	9,0 %
36-60	10,0 %	4,1 %	6,7 %	7,0 %
61-90	-	7,0 %	5,1 %	6,8 %
91-180	-	6,2 %	7,0 %	6,5 %
>180	7,8 %	6,9 %	6,2 %	6,9 %
Total	17,4 %	-1,4 %	1,7 %	1,0 %

*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	24 al 28 de Noviembre				1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	157	33	1511	1706	45	15	1023	1193	20	21	732	904
Otros***	33	157	1332	1334	15	45	798	818	21	20	705	574
Intragrupo	0	0	255	58	0	0	213	24	0	0	47	7
Total	190	190	3098	3098	60	60	2034	2034	40	40	1484	1484

* 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