

Fecha de Publicación: 28 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 26 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\$607,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	128,7	168,2	82,2	86,7	44,0	-	255,0
15-35	127,0	83,2	46,2	88,5	-	1,5	173,3
36-60	41,2	96,8	96,8	41,2	-	-	138,1
61-90	12,5	13,8	1,8	0,5	-	-	14,3
91-180	0,3	22,2	22,2	0,3	-	-	22,5
>180	2,4	4,2	2,2	0,4	-	-	4,6
Total	312,2	388,4	251,4	217,7	44,0	1,5	607,6

* 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	-19,9 %	7,4 %	24,1 %	8,9 %
15-35	-2,9 %	1,2 %	4,6 %	2,1 %
36-60	-	6,7 %	5,4 %	6,3 %
61-90	6,6 %	6,1 %	11,2 %	6,7 %
91-180	-	5,9 %	5,0 %	5,9 %
>180	7,1 %	7,2 %	7,2 %	7,2 %
Total	-9,1 %	5,9 %	12,6 %	6,0 %

*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	1510	1696	46	17	1147	1325	20	21	780	963
Otros***	33	157	1322	1333	17	46	844	900	21	20	757	615
Intragrupo	0	0	255	58	0	0	257	24	0	0	47	7
Total	190	190	3087	3087	63	63	2248	2248	41	41	1585	1585

* 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