

Fecha de Publicación: 1 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 27 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\$116,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,3	5,0	5,0	4,3	-	-	9,3
15-35	37,6	25,1	25,1	37,6	-	-	62,7
36-60	23,0	5,0	5,0	23,0	-	-	28,0
61-90	0,0	6,3	6,3	0,0	-	-	6,3
91-180	5,0	5,4	5,4	5,0	-	-	10,4
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	70,0	46,8	46,7	69,9	-	-	116,7

* 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	-	-5,1 %	17,4 %	5,4 %
15-35	12,7 %	10,5 %	0,0 %	4,2 %
36-60	-	9,0 %	7,6 %	7,9 %
61-90	-	7,3 %	-	7,3 %
91-180	-	7,2 %	6,3 %	6,7 %
>180	-	-	-	-
Total	12,7 %	7,9 %	4,1 %	5,6 %

*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	32	1510	1682	46	17	1151	1329	20	21	811	964
Otros***	32	157	1308	1333	17	46	848	903	21	20	758	645
Intragrupo	0	0	255	58	0	0	257	24	0	0	47	7
Total	189	189	3073	3073	63	63	2256	2256	41	41	1616	1616

* 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