

Fecha de Publicación: 3 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 01 de Diciembre 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\$498,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	224,1	28,5	13,2	163,8	-	45,0	237,3
15-35	75,9	126,4	96,4	32,9	2,0	15,0	174,3
36-60	40,5	45,1	20,1	30,5	15,0	-	75,6
61-90	0,0	0,2	0,2	0,0	-	-	0,2
91-180	0,3	4,6	4,6	0,3	-	-	4,9
>180	5,9	0,1	0,1	5,9	-	-	6,0
Total	346,6	205,1	134,8	233,3	17,0	60,0	498,4

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

*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	1 al 5 de Diciembre				8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	123	21	1233	1383	21	21	917	974	13	34	916	1177
Otros***	21	123	861	970	21	21	768	707	34	13	912	758
Intragrupo	0	0	282	24	0	0	47	52	0	0	159	51
Total	144	144	2377	2377	42	42	1733	1733	47	47	1986	1986

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo