

Fecha de Publicación: 5 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 03 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\$390,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	92,9	41,5	16,5	67,9	-	-	109,4
15-35	53,6	178,9	130,9	20,6	16,0	1,0	200,5
36-60	30,5	20,7	20,7	30,5	-	-	51,2
61-90	0,1	13,3	13,3	0,1	-	-	13,4
91-180	0,0	4,1	4,1	0,0	-	-	4,1
>180	0,0	12,2	12,2	0,0	-	-	12,2
Total	177,1	270,8	197,8	119,1	16,0	1,0	390,9

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

*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	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**	122	23	1247	1429	23	21	1089	1054	13	35	997	1267
Otros***	23	122	908	984	21	23	812	843	35	13	985	823
Intragrupo	0	0	282	24	0	0	47	52	0	0	159	51
Total	144	144	2437	2437	44	44	1949	1949	47	47	2140	2140

* 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