

Fecha de Publicación: 26 de Noviembre de 2008
Fecha de Información: 24 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\$568,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	97,9	62,4	61,2	93,5	-	3,2	159,1
15-35	162,9	108,3	81,2	149,8	19,0	5,0	263,1
36-60	29,0	9,5	9,5	29,0	-	-	38,5
61-90	0,2	6,5	6,5	0,2	-	-	6,8
91-180	0,6	21,3	21,3	0,6	-	-	21,8
>180	5,0	74,1	74,1	5,0	-	-	79,1
Total	295,6	282,1	253,8	278,1	19,0	8,2	568,4

* 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	8,1 %	-1,7 %	21,9 %	12,3 %
15-35	5,0 %	11,0 %	3,1 %	5,8 %
36-60	-	8,1 %	6,2 %	6,7 %
61-90	-	8,0 %	6,4 %	7,9 %
91-180	-	7,7 %	7,2 %	7,6 %
>180	-	8,3 %	7,5 %	8,2 %
Total	5,4 %	6,7 %	9,7 %	8,2 %

*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**	156	31	1451	1584	44	15	896	1149	9	20	708	886
Otros***	31	156	1237	1275	15	44	765	702	20	9	691	550
Intragrupo	0	0	228	58	0	0	213	24	0	0	44	7
Total	188	188	2916	2916	59	59	1875	1875	29	29	1443	1443

* 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