

Fecha de Publicación: 10 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 05 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\$769,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	117,6	122,9	104,9	114,6	15,0	-	237,5
15-35	77,4	280,6	127,0	42,3	138,5	20,0	342,9
36-60	42,4	43,9	33,9	32,4	-	-	76,3
61-90	2,1	39,8	4,8	2,1	35,0	-	42,0
91-180	3,8	31,2	31,2	3,8	-	-	34,9
>180	29,9	10,7	5,7	24,9	-	-	35,6
Total	273,2	529,0	307,4	220,1	188,5	20,0	769,1

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

*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	34	21	1203	1206	14	38	1060	1338
Otros***	23	122	908	984	21	34	903	955	38	14	1044	884
Intragrupo	0	0	282	24	0	0	107	52	0	0	169	51
Total	145	145	2437	2437	54	54	2213	2213	52	52	2273	2273

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio SET FX}) \wedge (365/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo