

Fecha de Publicación: 11 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 09 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\$752,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	259,9	144,8	99,3	144,7	30,3	100,0	389,5
15-35	73,5	94,4	69,2	58,3	10,0	-	152,7
36-60	92,5	28,6	28,6	62,4	-	30,1	121,1
61-90	0,8	33,3	33,3	0,8	-	-	34,1
91-180	9,0	18,9	8,9	9,0	10,0	-	27,9
>180	0,0	27,1	27,1	0,0	-	-	27,1
Total	435,7	347,0	266,3	275,3	50,3	130,1	752,4

* 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	1,5 %	-6,3 %	18,6 %	7,6 %
15-35	5,3 %	8,1 %	7,5 %	7,6 %
36-60	-	8,0 %	5,2 %	6,1 %
61-90	-	7,2 %	7,3 %	7,2 %
91-180	-	7,7 %	6,0 %	6,8 %
>180	-	7,0 %	-	7,0 %
Total	3,4 %	2,5 %	12,5 %	7,3 %

*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	8 al 12 de Diciembre				15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	33	21	1300	1253	54	38	1177	1427	93	30	449	505
Otros***	21	33	949	1012	38	54	1088	926	30	93	368	375
Intragrupo	0	0	107	92	0	0	199	111	0	0	75	12
Total	54	54	2357	2357	92	92	2464	2464	123	123	892	892

* 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