

Fecha de Publicación: 12 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 10 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\$598,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	196,9	77,8	40,8	184,9	25,0	-	262,7
15-35	50,9	201,9	172,1	20,1	-	1,0	223,0
36-60	57,8	15,1	15,1	57,8	-	-	72,8
61-90	8,4	13,3	13,3	8,4	-	-	21,7
91-180	2,9	6,2	6,2	2,9	-	-	9,1
>180	0,2	9,1	9,1	0,2	-	-	9,4
Total	317,1	323,4	256,6	274,3	25,0	1,0	598,7

* 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	14,7 %	6,6 %	4,7 %	5,5 %
15-35	8,5 %	7,2 %	6,7 %	7,3 %
36-60	-	7,4 %	6,3 %	6,5 %
61-90	-	7,4 %	7,3 %	7,4 %
91-180	-	8,6 %	5,9 %	7,7 %
>180	-	7,4 %	6,4 %	7,3 %
Total	10,3 %	7,1 %	5,3 %	6,5 %

*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	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	1299	1253	54	40	1368	1482	94	31	460	534
Otros***	21	33	949	1011	40	54	1106	1105	31	94	392	381
Intragrupo	0	0	107	92	0	0	224	111	0	0	75	12
Total	54	54	2356	2356	94	94	2698	2698	125	125	927	927

* 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