

Fecha de Publicación: 15 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 11 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\$876,9 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 | 144,8 | 170,6 | 89,4 | 143,6 | 80,0 | - | 314,2 |
| 15-35 | 192,1 | 151,5 | 119,1 | 140,7 | - | 19,0 | 311,2 |
| 36-60 | 88,4 | 14,0 | 13,9 | 88,3 | - | - | 102,2 |
| 61-90 | 62,8 | 43,9 | 17,1 | 40,9 | 5,0 | - | 84,8 |
| 91-180 | 3,0 | 42,6 | 39,6 | 0,0 | - | - | 42,6 |
| >180 | 2,1 | 19,7 | 19,7 | 2,1 | - | - | 21,8 |
| Total | 493,1 | 442,3 | 298,8 | 415,6 | 85,0 | 19,0 | 876,9 |

* 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 | -11,0 % | -2,4 % | 8,4 % | 4,2 % |
| 15-35 | 11,0 % | 8,3 % | 7,4 % | 8,2 % |
| 36-60 | 3,4 % | 6,9 % | 5,8 % | 5,9 % |
| 61-90 | 9,2 % | 8,0 % | 4,9 % | 6,7 % |
| 91-180 | 8,2 % | 8,2 % | - | 8,2 % |
| >180 | - | 7,6 % | 6,3 % | 7,5 % |
| Total | 9,7 % | 5,0 % | 7,2 % | 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 | 22 | 1300 | 1245 | 55 | 44 | 1445 | 1635 | 94 | 33 | 525 | 546 |
| Otros*** | 22 | 33 | 941 | 1012 | 44 | 55 | 1178 | 1181 | 33 | 94 | 405 | 447 |
| Intragrupo | 0 | 0 | 107 | 92 | 0 | 0 | 304 | 111 | 0 | 0 | 75 | 12 |
| Total | 55 | 55 | 2349 | 2349 | 99 | 99 | 2927 | 2927 | 127 | 127 | 1005 | 1005 |

* 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