

Fecha de Publicación: 17 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 15 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\$415,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	106,9	78,9	61,9	89,5	-	0,4	168,9
15-35	41,6	105,5	62,3	31,4	33,0	-	136,9
36-60	70,9	15,6	15,6	70,9	-	-	86,5
61-90	1,0	3,2	2,2	0,0	-	-	3,2
91-180	0,4	10,4	10,4	0,4	-	-	10,7
>180	2,4	7,0	7,0	2,4	-	-	9,5
Total	223,2	220,7	159,4	194,5	33,0	0,4	415,6

* 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	11,1 %	9,5 %	6,5 %	8,1 %
15-35	1,6 %	10,8 %	7,0 %	8,7 %
36-60	6,3 %	8,2 %	6,4 %	6,8 %
61-90	7,6 %	6,9 %	-	7,1 %
91-180	-	7,6 %	6,1 %	7,6 %
>180	-	7,5 %	6,1 %	7,2 %
Total	7,6 %	9,6 %	6,6 %	7,9 %

*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	15 al 19 de Diciembre				22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	67	47	1668	1789	95	33	578	580	1	14	364	573
Otros***	47	67	1322	1389	33	95	414	475	14	1	476	293
Intragrupo	0	1	304	116	0	0	75	12	0	0	42	16
Total	114	114	3293	3293	128	128	1067	1067	16	16	882	882

* 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