

Fecha de Publicación: 18 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 16 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\$651,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Otros Agentes sin intragrupo | | Intragrupo*** | | Total |
|--------------|---------------------|--------------|------------------------------|--------------|---------------|-------------|--------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 142,6 | 102,8 | 97,7 | 117,5 | - | 20,0 | 240,3 |
| 15-35 | 159,0 | 172,7 | 96,4 | 89,5 | 34,3 | 27,5 | 289,7 |
| 36-60 | 11,0 | 56,9 | 36,9 | 11,0 | 20,0 | - | 68,0 |
| 61-90 | 1,3 | 11,2 | 11,1 | 1,2 | - | - | 12,4 |
| 91-180 | 0,1 | 22,9 | 22,9 | 0,1 | - | - | 23,0 |
| >180 | 10,0 | 8,0 | 8,0 | 10,0 | - | - | 18,0 |
| Total | 324,1 | 374,6 | 273,0 | 229,3 | 54,3 | 47,5 | 651,4 |

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

*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

| Sectores | 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** | 68 | 50 | 1744 | 1850 | 95 | 33 | 632 | 617 | 1 | 14 | 375 | 574 |
| Otros*** | 50 | 68 | 1383 | 1465 | 33 | 95 | 446 | 503 | 14 | 1 | 477 | 304 |
| Intragrupo | 0 | 1 | 304 | 116 | 0 | 0 | 75 | 32 | 0 | 0 | 42 | 16 |
| Total | 118 | 118 | 3431 | 3431 | 128 | 128 | 1153 | 1153 | 16 | 16 | 894 | 894 |

* 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