

Fecha de Publicación: 22 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 18 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\$623,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 10,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	74,0	58,8	53,2	48,8	5,5	25,0	132,7
15-35	145,8	219,9	107,8	77,3	91,6	48,0	345,2
36-60	25,9	9,1	9,1	25,9	-	-	35,0
61-90	15,9	81,5	21,4	5,9	50,0	-	87,4
91-180	5,3	13,3	8,3	0,3	-	-	13,7
>180	2,0	8,0	8,0	2,0	-	-	10,0
Total	269,0	390,7	207,8	160,2	147,1	73,0	623,9

* 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	-2,8 %	3,6 %	34,2 %	17,8 %
15-35	6,4 %	8,3 %	7,2 %	7,7 %
36-60	8,1 %	8,7 %	7,7 %	7,9 %
61-90	5,7 %	9,3 %	3,7 %	7,4 %
91-180	7,6 %	7,4 %	6,2 %	7,5 %
>180	-	7,5 %	0,4 %	6,1 %
Total	6,4 %	7,2 %	14,4 %	10,0 %

*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**	68	50	1754	1942	98	32	749	769	1	15	393	588
Otros***	50	68	1390	1475	32	97	597	575	15	1	486	322
Intragrupo	0	1	389	116	0	1	75	77	0	0	48	16
Total	118	118	3533	3533	129	129	1421	1421	16	16	926	926

* 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