

Fecha de Publicación: 23 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 19 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\$342,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	47,2	38,2	38,2	46,3	-	0,9	85,4
15-35	91,6	83,0	66,0	76,6	3,0	1,0	160,6
36-60	31,8	6,0	6,0	31,8	-	-	37,9
61-90	17,4	8,6	8,6	17,4	-	-	26,0
91-180	3,3	17,2	17,2	3,3	-	-	20,5
>180	2,8	9,4	9,4	2,8	-	-	12,2
Total	194,2	162,5	145,5	178,2	3,0	1,9	342,6

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

*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	1753	1939	100	27	794	805	1	16	401	593
Otros***	50	68	1387	1474	27	98	634	621	16	1	491	330
Intragrupo	0	1	389	116	0	1	75	77	0	0	48	16
Total	118	118	3530	3530	127	127	1503	1503	17	17	940	940

* 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