

Fecha de Publicación: 24 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 22 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\$300,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	52,8	21,6	21,6	42,8	-	10,0	74,4
15-35	71,8	118,1	80,1	33,8	4,0	4,0	155,9
36-60	21,5	3,1	3,0	21,4	-	-	24,5
61-90	8,4	4,0	4,0	0,4	-	8,0	12,4
91-180	1,0	21,5	21,5	1,0	-	-	22,5
>180	10,3	10,3	0,3	0,3	-	-	10,6
Total	165,8	178,6	130,5	99,8	4,0	22,0	300,3

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

*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

Sectores	22 al 26 de Diciembre				29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	102	27	824	821	2	15	415	594	1	24	682	922
Otros***	27	101	649	641	15	2	491	344	24	1	726	556
Intragrupo	0	1	75	87	0	0	48	16	0	0	113	43
Total	129	129	1549	1549	18	18	954	954	26	26	1521	1521

* 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: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo