

Fecha de Publicación: 26 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 23 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\$352,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	64,7	31,6	23,6	6,7	-	50,0	88,3
15-35	175,2	108,9	53,6	118,9	1,0	2,0	229,8
36-60	8,1	12,9	12,9	8,1	-	-	21,0
61-90	0,3	3,3	3,3	0,3	-	-	3,5
91-180	0,3	8,7	8,7	0,3	-	-	9,0
>180	0,0	0,6	0,6	0,0	-	-	0,6
Total	248,5	165,9	102,6	134,2	1,0	52,0	352,2

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

*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	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	26	824	822	4	19	469	598	1	25	752	1001
Otros***	26	101	650	641	19	4	495	348	25	1	773	595
Intragrupo	0	1	75	87	0	0	48	66	0	0	113	43
Total	128	128	1550	1550	23	23	1012	1012	26	26	1639	1639

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