

Fecha de Publicación: 29 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 24 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\$75,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	25,2	1,2	1,1	25,1	-	-	26,3
15-35	6,3	36,4	35,4	5,2	-	-	41,6
36-60	1,8	2,5	1,5	0,8	-	-	3,2
61-90	0,3	0,6	0,6	0,3	-	-	0,9
91-180	0,1	0,4	0,4	0,1	-	-	0,5
>180	1,8	1,1	1,1	1,8	-	-	2,9
Total	35,4	42,2	40,0	33,3	-	-	75,5

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

*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**	98	26	829	823	4	21	494	599	1	24	753	1025
Otros***	26	96	651	646	21	4	496	373	24	1	797	595
Intragrupo	0	1	75	87	0	0	48	66	0	0	113	43
Total	124	124	1556	1556	25	25	1038	1038	25	25	1663	1663

* 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