

Fecha de Publicación: 30 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 26 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\$180,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	7,2	66,1	16,1	7,2	50,0	-	73,3
15-35	51,4	78,8	35,3	14,4	6,5	-	93,2
36-60	0,0	9,6	9,6	0,0	-	-	9,6
61-90	0,2	2,2	2,2	0,2	-	-	2,5
91-180	0,0	2,0	2,0	0,0	-	-	2,0
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	58,9	158,8	65,3	21,9	56,5	-	180,6

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

*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**	99	26	829	823	4	21	494	649	1	24	759	1041
Otros***	26	97	651	646	21	4	496	373	24	1	813	601
Intragrupo	0	1	75	87	0	0	98	66	0	0	113	43
Total	125	125	1556	1556	25	25	1088	1088	25	25	1686	1686

* 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