

Fecha de Publicación: 19 de Diciembre de 2008
Fecha de Información: 17 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\$426,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	53,2	100,1	99,9	32,5	-	20,6	153,1
15-35	105,2	64,3	57,3	99,2	6,0	5,0	168,6
36-60	49,5	9,8	9,7	49,5	-	-	59,2
61-90	6,2	15,8	15,8	6,2	-	-	22,0
91-180	1,5	13,8	13,8	1,5	-	-	15,3
>180	0,0	7,8	7,8	0,0	-	-	7,8
Total	215,6	211,6	204,4	188,9	6,0	25,6	426,0

* 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	32,6 %	21,8 %	43,1 %	27,1 %
15-35	14,8 %	7,9 %	7,6 %	7,8 %
36-60	8,8 %	8,0 %	7,7 %	7,7 %
61-90	-	7,5 %	5,3 %	6,9 %
91-180	-	8,6 %	5,8 %	8,3 %
>180	-	8,3 %	5,7 %	8,3 %
Total	16,3 %	14,5 %	13,5 %	14,0 %

*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	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	47	1750	1937	98	32	681	718	1	15	379	574
Otros***	47	68	1385	1471	32	97	547	533	15	1	477	308
Intragrupo	0	1	389	116	0	1	75	52	0	0	42	16
Total	115	115	3524	3524	130	130	1303	1303	16	16	898	898

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