

Fecha de Publicación: 3 de Febrero de 2009
Fecha de Información: 30 de Enero de 2009 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\$677,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	73,2	170,1	64,9	73,0	105,0	-	243,1
15-35	82,7	198,9	198,8	82,5	-	-	281,4
36-60	29,0	70,3	70,3	29,0	-	-	99,3
61-90	3,8	10,9	10,9	3,8	-	-	14,7
91-180	5,3	24,5	24,5	5,3	-	-	29,8
>180	6,2	3,1	3,1	6,2	-	-	9,3
Total	200,2	477,8	372,4	199,7	105,0	-	677,5

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

*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

Sector	26 al 30 de Enero				2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	34	1196	1273	14	16	997	1121	15	21	999	1258
Otros***	34	19	912	887	16	13	713	798	21	15	760	648
Intragrupo	0	0	148	96	0	0	256	47	0	0	193	46
Total	53	53	2256	2256	30	30	1966	1966	36	36	1952	1952

* 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