

Fecha de Publicación: 5 de Febrero de 2009
Fecha de Información: 03 de Febrero de 2009¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$558,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	113,9	57,3	17,3	83,9	10,0	-	141,1
15-35	128,3	193,1	145,4	80,6	3,7	3,7	277,4
36-60	86,1	23,1	18,1	81,1	-	-	104,2
61-90	4,6	25,2	25,2	4,6	-	-	29,8
91-180	1,3	0,9	0,9	1,3	-	-	2,2
>180	3,9	0,1	0,1	3,9	-	-	3,9
Total	337,9	299,7	207,0	255,2	13,7	3,7	558,6

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

*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	2 al 6 de Febrero				9 al 13 de Febrero				16 al 20 de Febrero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	17	1070	1173	17	21	1133	1340	7	28	778	1046
Otros***	17	13	759	866	21	17	782	751	28	7	703	595
Intragrupo	0	0	256	47	0	0	223	46	0	0	169	8
Total	31	31	2085	2085	38	38	2137	2137	35	35	1649	1649

* 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