

Fecha de Publicación: 25 de Febrero de 2009
Fecha de Información: 23 de Febrero 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\$567,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 14,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	174,3	60,6	5,0	112,6	45,5	51,6	224,8
15-35	153,7	149,5	106,0	35,2	18,1	93,1	277,8
36-60	19,2	13,6	10,0	10,0	3,6	9,2	32,8
61-90	4,1	1,1	0,0	0,0	1,1	4,1	5,2
91-180	0,2	15,0	0,0	0,0	15,0	0,2	15,2
>180	1,0	10,8	0,0	0,0	10,8	1,0	11,8
Total	352,4	250,7	121,0	157,8	94,2	159,2	567,7

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-25,7 %	-12,3 %	40,3 %	24,1 %
15-35	6,4 %	14,9 %	5,4 %	9,2 %
36-60	-	11,4 %	11,9 %	11,7 %
61-90	-	8,2 %	9,9 %	9,5 %
91-180	-	7,6 %	6,2 %	7,6 %
>180	-	6,2 %	6,7 %	6,2 %
Total	-2,7 %	6,8 %	22,2 %	14,8 %

*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	23 al 27 de Febrero				2 al 6 de Marzo				9 al 13 de Marzo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	38	1653	2022	7	15	974	1261	9	12	632	1024
Intragrupa y off-shore***	0	0	1183	511	0	0	820	251	0	0	730	107
Otros	38	13	500	804	15	7	286	568	12	9	170	400
Total	52	52	3337	3337	22	22	2080	2080	21	21	1531	1531

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

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