

Fecha de Publicación: 5 de Enero de 2009
Fecha de Información: 30 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\$373,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,8%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	38,1	76,7	16,6	38,1	60,0	-	114,8
15-35	49,2	181,4	151,4	46,2	27,0	-	227,6
36-60	17,1	0,7	0,7	17,1	-	-	17,8
61-90	2,9	0,9	0,9	2,9	-	-	3,8
91-180	4,4	4,9	4,9	4,4	-	-	9,3
>180	0,3	0,0	0,0	0,3	-	-	0,3
Total	112,0	264,6	174,5	109,0	87,0	-	373,5

* 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	16,6 %	8,0 %	13,1 %	11,6 %
15-35	6,6 %	7,5 %	6,3 %	7,2 %
36-60	-	8,1 %	4,3 %	4,4 %
61-90	-	8,3 %	5,7 %	6,3 %
91-180	-	7,9 %	6,1 %	7,0 %
>180	-	8,1 %	6,5 %	6,7 %
Total	6,7 %	7,6 %	8,3 %	7,8 %

*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

Sector	29 de Dic. al 2 de Enero				5 al 9 de Enero				12 al 16 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	25	494	649	4	24	918	1134	28	21	947	909
Otros***	25	5	496	373	24	4	846	720	21	28	661	746
Intragrupo	0	0	98	66	0	0	173	83	0	0	107	60
Total	30	30	1088	1088	28	28	1937	1937	50	50	1715	1715

* 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