

Fecha de Publicación: 7 de Enero de 2009
Fecha de Información: 05 de Enero 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\$391,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 7,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	89,6	7,9	7,0	39,6	0,9	50,0	97,5
15-35	117,7	134,1	119,1	102,7	-	-	236,9
36-60	5,5	2,1	2,1	5,5	-	-	7,6
61-90	0,0	43,0	43,0	0,0	-	-	43,0
91-180	0,0	6,4	6,4	0,0	-	-	6,4
>180	0,0	0,0	0,0	0,0	-	-	0,0
Total	212,9	193,6	177,7	147,9	0,9	50,0	391,5

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

*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

Sectores	5 al 9 de Enero				12 al 16 de Enero				19 al 23 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	4	25	942	1171	30	22	1040	983	10	41	659	478
Otros***	24	4	873	724	22	30	655	779	41	10	282	464
Intragrupo	1	0	173	93	0	0	177	110	0	0	76	75
Total	29	29	1988	1988	52	52	1871	1871	51	51	1017	1017

* 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