

Fecha de Publicación: 4 de Febrero de 2009
Fecha de Información: 02 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\$443,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 8,6%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Otros Agentes sin intragrupo		Intragrupo***		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	84,7	81,0	45,0	68,7	20,0	-	149,7
15-35	72,1	201,8	155,8	26,1	5,0	5,0	232,8
36-60	13,5	18,2	7,2	7,5	5,0	-	25,7
61-90	5,5	11,1	11,1	5,5	-	-	16,6
91-180	0,7	2,8	2,8	0,7	-	-	3,5
>180	5,1	10,0	10,0	5,1	-	-	15,1
Total	181,6	324,9	231,9	113,6	30,0	5,0	443,4

* 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	15,8 %	-22,5 %	22,6 %	6,1 %
15-35	11,0 %	10,6 %	8,7 %	10,4 %
36-60	8,8 %	7,4 %	9,0 %	8,4 %
61-90	-	7,0 %	7,2 %	7,1 %
91-180	-	5,8 %	5,3 %	5,7 %
>180	-	6,8 %	5,2 %	6,3 %
Total	12,0 %	3,7 %	16,9 %	8,6 %

*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**	13	16	1063	1167	16	21	1058	1300	7	27	674	998
Otros***	16	12	758	864	21	16	766	691	27	7	698	531
Intragrupo	0	0	256	47	0	0	213	46	0	0	165	8
Total	29	29	2077	2077	37	37	2037	2037	34	34	1537	1537

* 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