

Fecha de Publicación: 18 de Marzo de 2009
Fecha de Información: 16 de Marzo 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\$860,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.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	134,5	127,3	53,8	99,0	72,8	34,8	261,1
15-35	191,5	168,5	79,0	70,0	31,4	63,4	301,9
36-60	106,4	7,9	0,0	22,0	7,9	84,4	114,3
61-90	9,7	127,1	70,0	5,5	57,1	4,3	136,8
91-180	0,8	17,2	0,0	0,0	17,2	0,8	18,0
>180	22,2	24,2	0,0	0,0	6,2	4,2	28,4
Total	465,1	472,2	202,8	196,5	192,6	191,9	860,5

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

*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	16 al 20 de Marzo				23 al 27 de Marzo				30 de Mar. al 3 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	71	1596	2169	7	24	855	916	6	25	919	1216
Intragrupa y off-shore***	4	1	1366	485	0	0	436	251	0	0	806	320
Otros	66	11	542	850	24	7	386	510	25	6	269	457
Total	83	83	3504	3504	31	31	1677	1677	31	31	1993	1993

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo