

Fecha de Publicación: 16 de Junio de 2009
Fecha de Información: 11 de Junio 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\$956,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	123,7	244,6	177,0	35,3	37,6	58,4	338,3
15-35	298,4	274,3	180,3	118,0	35,7	122,1	514,4
36-60	3,8	52,4	50,0	0,0	2,4	3,8	56,2
61-90	0,4	4,3	0,0	0,0	4,3	0,4	4,7
91-180	1,3	12,6	0,0	1,0	12,6	0,3	14,0
>180	0,5	28,6	15,0	0,0	13,6	0,5	29,1
Total	428,1	616,9	422,3	154,3	106,3	185,6	956,7

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4 %	3,9 %	4,2 %	4,2 %
15-35	5,7 %	5,2 %	4,9 %	5,1 %
36-60	-	5,6 %	5,1 %	5,6 %
61-90	-	5,7 %	4,2 %	5,6 %
91-180	-	5,9 %	4,6 %	5,7 %
>180	-	5,4 %	-0,9 %	5,3 %
Total	5,6 %	5,0 %	4,7 %	5,0 %

*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	8 al 12 de Junio				15 al 19 de Junio				22 al 26 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	27	2201	2215	18	34	1599	1500	5	23	1081	1134
Intragruppo y off-shore***	0	1	1428	1044	3	0	821	605	0	0	561	202
Otros	27	18	474	843	30	18	392	707	23	5	376	682
Total	46	46	4102	4102	52	52	2812	2812	28	28	2018	2018

* 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 intragruppo