

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2009
 Fecha de Información: 12 de Junio 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\$824,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	179,9	169,9	100,0	94,2	59,8	75,6	339,7
15-35	202,3	227,0	203,0	69,0	11,9	121,2	417,2
36-60	28,8	13,2	0,0	0,0	7,2	22,7	36,0
61-90	0,6	2,5	0,0	0,0	2,5	0,6	3,1
91-180	12,5	11,0	7,0	12,0	4,0	0,5	23,6
>180	0,0	5,1	0,5	0,0	4,6	0,0	5,1
Total	424,2	428,8	310,5	175,2	90,1	220,7	824,7

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4 %	5,7 %	5,3 %	5,4 %
15-35	5,7 %	5,9 %	6,0 %	5,9 %
36-60	0,0 %	5,6 %	5,2 %	4,4 %
61-90	-	5,4 %	4,4 %	5,2 %
91-180	-	5,5 %	5,3 %	5,4 %
>180	-	5,5 %	4,0 %	5,5 %
Total	4,4 %	5,8 %	5,6 %	5,6 %

*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

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	26	2201	2223	19	33	1676	1628	5	23	1185	1169
Intragrupa y off-shore***	0	1	1436	1044	3	1	906	620	0	0	568	280
Otros	26	18	474	843	30	18	425	758	23	5	404	708
Total	45	45	4110	4110	53	53	3006	3006	28	28	2157	2157

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