

Fecha de Publicación: 17 de Junio de 2009
Fecha de Información: 16 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\$491,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.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	151,8	116,2	75,3	90,5	24,5	44,8	251,5
15-35	81,1	152,0	119,1	16,0	17,9	50,1	218,1
36-60	1,3	12,2	0,0	0,0	12,2	1,3	13,5
61-90	0,3	0,5	0,0	0,0	0,5	0,3	0,8
91-180	1,1	4,1	0,0	1,0	4,1	0,1	5,1
>180	0,0	2,1	0,0	0,0	2,1	0,0	2,1
Total	235,6	287,2	194,4	107,5	61,3	96,6	491,2

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

*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	15 al 19 de Junio				22 al 26 de Junio				29 de Jun. al 3 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	35	1719	1675	7	23	1294	1236	9	21	1053	887
Intragruppo y off-shore***	3	1	933	646	0	0	616	345	0	0	649	451
Otros	32	19	444	776	23	7	406	735	21	9	118	482
Total	56	56	3097	3097	30	30	2316	2316	29	29	1820	1820

* 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