

Fecha de Publicación: 19 de Junio de 2009
Fecha de Información: 17 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\$758,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	273,5	93,6	43,0	125,0	50,6	148,5	367,1
15-35	163,8	157,4	92,5	60,5	59,9	98,3	316,2
36-60	52,2	4,2	0,0	35,4	3,8	16,4	56,0
61-90	0,6	6,8	3,6	0,0	3,1	0,5	7,2
91-180	0,5	5,3	1,0	0,0	4,2	0,4	5,7
>180	0,0	6,6	0,0	0,0	6,6	0,0	6,7
Total	490,6	273,9	140,1	220,9	128,3	264,1	758,9

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

*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

Sector	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	38	1721	1674	11	25	1543	1312	9	21	1077	967
Intragrupo y off-shore***	3	1	933	646	0	0	654	470	0	0	694	451
Otros	35	19	443	778	25	11	445	859	21	9	152	505
Total	59	59	3098	3098	36	36	2641	2641	31	31	1923	1923

* 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