

Fecha de Publicación: 23 de Junio de 2009
Fecha de Información: 18 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\$992,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.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	216,9	293,8	186,0	57,0	90,4	142,5	493,3
15-35	172,5	269,6	216,8	24,0	27,7	123,5	417,0
36-60	5,0	17,4	15,0	0,0	2,4	5,0	22,4
61-90	0,6	4,0	0,0	0,0	4,0	0,6	4,5
91-180	0,4	2,5	0,0	0,0	2,5	0,4	2,9
>180	48,6	8,7	0,0	0,0	3,7	43,6	52,3
Total	444,0	596,0	417,8	81,0	130,7	315,5	992,5

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

*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	37	1723	1674	11	28	1657	1556	9	22	1182	1016
Intragruppo y off-shore***	3	1	933	646	0	0	830	499	0	0	704	479
Otros	34	19	443	780	28	11	505	937	22	9	182	572
Total	57	57	3100	3100	39	39	2992	2992	31	31	2067	2067

* 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