

Fecha de Publicación: 24 de Junio de 2009
Fecha de Información: 19 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\$680,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.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	47,4	208,0	102,0	2,8	105,3	43,9	254,7
15-35	247,6	130,8	91,5	51,0	31,3	188,6	370,4
36-60	7,2	14,0	10,0	0,0	4,0	7,1	21,2
61-90	2,3	2,3	0,0	0,0	2,3	2,3	4,6
91-180	10,3	16,9	0,0	0,0	13,9	7,3	24,2
>180	0,9	5,0	0,0	0,0	5,0	0,9	5,9
Total	315,7	377,0	203,5	53,8	161,7	250,1	680,9

* 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	5,0 %	5,7 %	5,2 %	5,6 %
15-35	4,6 %	6,7 %	5,3 %	5,7 %
36-60	5,3 %	5,6 %	5,3 %	5,5 %
61-90	-	6,1 %	4,5 %	5,3 %
91-180	5,6 %	5,8 %	4,7 %	5,5 %
>180	-	6,4 %	4,5 %	6,1 %
Total	4,9 %	6,1 %	5,3 %	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	10	28	1545	1417	9	21	1075	999
Intragrupo y off-shore***	3	1	933	646	0	0	758	470	0	0	737	451
Otros	34	19	444	780	28	10	446	862	21	9	142	504
Total	57	57	3100	3100	38	38	2749	2749	31	31	1954	1954

* 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