

Fecha de Publicación: 26 de Junio de 2009
Fecha de Información: 24 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\$907,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.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	158,1	118,1	20,0	35,0	23,9	49,0	202,0
15-35	363,0	368,0	249,1	8,8	6,9	242,2	619,0
36-60	47,4	24,5	0,0	0,0	4,5	27,4	51,9
61-90	6,2	20,6	18,0	0,0	2,6	6,2	26,7
91-180	2,6	4,3	0,0	0,0	4,3	2,6	7,0
>180	1,0	0,2	0,0	0,0	0,2	1,0	1,1
Total	578,2	535,7	287,1	43,8	42,4	328,3	907,8

* 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 %	6,1 %	5,5 %	5,3 %
15-35	5,9 %	6,3 %	5,7 %	5,9 %
36-60	5,4 %	9,9 %	5,5 %	5,8 %
61-90	-	5,6 %	5,1 %	5,5 %
91-180	-	6,0 %	4,7 %	5,5 %
>180	-	6,1 %	4,5 %	4,7 %
Total	5,4 %	6,2 %	5,6 %	5,8 %

*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	22 al 26 de Junio				29 de Jun. al 3 de Julio				6 al 10 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	27	1733	1697	13	23	1570	1286	10	21	1025	1178
Intragrupo y off-shore***	0	0	883	530	0	0	773	656	0	0	799	247
Otros	27	13	583	972	23	13	267	668	21	10	166	564
Total	40	40	3199	3199	36	36	2610	2610	31	31	1990	1990

* 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