

Fecha de Publicación: 1 de Julio de 2009
Fecha de Información: 26 de Junio de 2009 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$654,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.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	158,3	146,1	104,0	22,0	11,5	105,6	273,8
15-35	116,5	214,9	126,0	6,0	31,9	53,5	274,3
36-60	27,9	1,1	0,0	0,0	1,1	27,9	29,0
61-90	4,3	35,9	15,0	0,0	20,9	4,3	40,2
91-180	1,1	15,4	10,0	0,0	5,4	1,1	16,5
>180	0,1	20,1	0,0	0,0	20,1	0,1	20,2
Total	308,1	433,6	255,0	28,0	90,9	192,5	654,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,4 %	3,5 %	5,4 %	5,3 %
15-35	6,3 %	7,6 %	4,9 %	6,7 %
36-60	-	6,0 %	5,3 %	5,3 %
61-90	-	5,6 %	5,4 %	5,6 %
91-180	-	5,5 %	4,7 %	5,5 %
>180	-	5,3 %	4,6 %	5,3 %
Total	6,0 %	6,8 %	5,3 %	6,0 %

*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**	11	33	1763	1723	13	21	1699	1533	10	23	1170	1317
Intragruppo y off-shore***	0	0	883	530	0	0	933	663	0	0	906	265
Otros	33	11	609	1002	21	13	328	764	23	10	166	660
Total	44	44	3256	3256	34	34	2960	2960	33	33	2242	2242

* 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 intragruppo