

Fecha de Publicación: 19 de Marzo de 2009
Fecha de Información: 17 de Marzo 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\$595,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	70,3	68,6	23,0	27,6	45,2	42,3	138,5
15-35	170,2	173,0	118,0	89,0	40,9	67,1	329,1
36-60	31,0	37,9	25,0	21,0	12,8	9,8	68,8
61-90	24,7	8,1	0,0	19,0	8,1	5,7	32,9
91-180	1,4	13,3	0,0	0,0	13,3	1,4	14,8
>180	0,5	10,6	0,0	0,0	10,6	0,5	11,1
Total	298,2	311,6	166,0	156,6	131,0	127,0	595,2

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

Sector	16 al 20 de Marzo				23 al 27 de Marzo				30 de Mar. al 3 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	71	1633	2195	7	24	891	957	6	26	955	1253
Intragrupa y off-shore***	4	1	1366	491	0	0	459	272	0	0	806	337
Otros	66	11	568	882	24	7	404	525	26	6	305	476
Total	83	83	3568	3568	31	31	1754	1754	32	32	2066	2066

* 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