

Fecha de Publicación: 24 de Marzo de 2009
Fecha de Información: 19 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\$837,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	169,8	121,3	37,0	18,1	72,5	139,9	279,3
15-35	219,7	159,9	106,1	63,0	46,8	149,7	372,6
36-60	13,8	117,9	50,3	0,0	67,6	13,8	131,7
61-90	8,7	7,1	0,0	0,0	7,0	8,6	15,8
91-180	7,1	18,2	0,0	0,0	18,1	7,1	25,3
>180	0,7	12,3	0,0	0,0	12,3	0,7	13,0
Total	419,9	436,8	193,4	81,1	224,4	319,8	837,7

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

*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	1651	2287	6	24	1176	1141	7	25	1088	1362
Intragrupa y off-shore***	4	1	1458	491	0	0	504	361	0	0	827	347
Otros	66	11	568	900	24	6	532	711	25	7	355	560
Total	83	83	3678	3678	31	31	2212	2212	32	32	2269	2269

* 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