

Fecha de Publicación: 16 de Abril de 2009
Fecha de Información: 14 de Abril 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\$644,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,0%.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	171,6	49,5	20,0	111,5	27,4	57,9	219,0
15-35	166,0	199,0	88,0	97,1	103,0	60,9	357,0
36-60	2,4	5,4	0,0	0,0	5,1	2,1	7,5
61-90	34,2	0,5	0,0	0,0	0,5	34,2	34,7
91-180	1,9	9,6	4,2	0,0	5,4	1,9	11,5
>180	3,7	10,9	0,0	0,0	10,9	3,7	14,6
Total	379,8	275,0	112,2	208,6	152,4	160,7	644,4

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

Sectores	13 al 17 de Abril				20 al 24 de Abril				27 de Abr. al 1 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	38	171	1790	1877	8	24	1302	1316	7	30	969	1338
Intragrupa y off-shore***	0	0	1151	514	0	1	684	459	0	0	833	451
Otros	171	38	495	1045	24	7	330	540	30	7	345	359
Total	209	209	3436	3436	32	32	2315	2315	37	37	2148	2148

* 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