

Fecha de Publicación: 20 de Abril de 2009
Fecha de Información: 16 de Abril 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\$907,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	74,9	230,3	138,0	15,6	92,0	59,0	304,9
15-35	222,4	289,5	225,3	7,0	55,2	206,4	503,0
36-60	11,0	5,6	0,0	8,0	5,6	3,0	16,6
61-90	15,0	6,4	1,0	0,0	5,4	15,0	21,4
91-180	0,2	16,0	0,0	0,0	16,0	0,2	16,2
>180	0,0	45,0	30,0	0,0	15,0	0,0	45,0
Total	323,6	592,7	394,3	30,6	189,1	283,7	907,0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	5,6 %	3,8 %	3,3 %	3,6 %
15-35	6,1 %	6,7 %	5,8 %	6,3 %
36-60	-	6,4 %	5,3 %	5,7 %
61-90	-	6,0 %	5,9 %	5,9 %
91-180	-	5,1 %	4,9 %	5,1 %
>180	-	5,2 %	4,4 %	5,2 %
Total	6,1 %	5,8 %	5,2 %	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	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	1795	1884	8	28	1510	1638	8	32	1013	1356
Intragruppo y off-shore***	0	0	1153	514	0	1	859	522	0	0	841	455
Otros	171	38	500	1050	28	7	476	686	32	8	354	399
Total	209	209	3448	3448	36	36	2846	2846	40	40	2209	2209

* 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