

Fecha de Publicación: 14 de Mayo de 2009
Fecha de Información: 12 de Mayo 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\$621,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,4%.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	92,7	129,1	72,0	10,0	57,1	82,6	221,8
15-35	264,3	117,5	83,0	80,0	3,4	153,2	350,7
36-60	6,5	1,1	0,0	0,0	1,1	6,5	7,6
61-90	2,6	0,1	0,0	0,0	0,1	2,6	2,7
91-180	1,4	3,3	0,0	0,0	3,3	1,4	4,7
>180	0,2	33,5	30,0	0,0	3,5	0,2	33,7
Total	367,7	284,6	185,0	90,0	68,5	246,6	621,2

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

*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	11 al 15 de Mayo				18 al 22 de Mayo				25 al 29 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	20	25	1607	1852	6	33	1236	1642	6	28	688	694
Intragrupa y off-shore***	0	0	1286	748	0	0	1054	435	0	0	366	104
Otros	25	20	399	692	33	6	358	571	28	6	200	456
Total	45	45	3293	3293	39	39	2648	2648	35	35	1254	1254

* 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 intragrupo