

Fecha de Publicación: 2 de Junio de 2009
Fecha de Información: 29 de Mayo 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\$500,5 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	65,9	48,5	19,0	7,7	28,5	57,2	113,4
15-35	147,7	140,5	72,1	68,0	53,4	64,7	273,2
36-60	13,5	36,6	13,0	13,0	23,6	0,5	50,1
61-90	0,0	10,1	1,0	0,0	9,1	0,0	10,1
91-180	0,1	32,8	0,0	0,0	32,8	0,1	32,9
>180	0,0	20,9	0,0	0,0	20,9	0,0	20,9
Total	227,2	289,3	105,1	88,7	168,3	122,5	500,5

* 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 %	5,9 %	1,0 %	3,0 %
15-35	6,5 %	6,8 %	6,0 %	6,4 %
36-60	-	6,5 %	6,7 %	6,6 %
61-90	-	6,0 %	5,0 %	6,0 %
91-180	-	5,5 %	5,4 %	5,5 %
>180	-	5,0 %	-	5,0 %
Total	6,5 %	6,3 %	4,5 %	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	25 al 29 de Mayo				1 al 5 de Junio				8 al 12 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	29	1086	1093	7	27	1231	1315	4	26	1432	1555
Intragrupa y off-shore***	0	0	590	212	0	2	880	429	0	0	1061	662
Otros	29	10	316	688	27	6	274	642	26	4	265	541
Total	39	39	1993	1993	34	34	2385	2385	30	30	2758	2758

* 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