

Fecha de Publicación: 17 de Abril de 2009
Fecha de Información: 15 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\$880,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.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	171,8	118,8	50,0	47,0	68,8	124,8	290,6
15-35	163,3	266,4	195,0	134,0	71,4	29,3	429,7
36-60	128,9	6,4	0,0	125,0	6,4	3,9	135,3
61-90	0,4	6,1	0,0	0,0	6,1	0,4	6,6
91-180	0,1	12,9	0,0	0,0	12,9	0,1	12,9
>180	0,0	5,7	0,0	0,0	5,7	0,0	5,7
Total	464,5	416,2	245,0	306,0	171,3	158,5	880,7

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

*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	1790	1876	8	27	1447	1421	7	31	1003	1344
Intragruppo y off-shore***	0	0	1151	514	0	1	726	506	0	0	836	455
Otros	171	38	494	1045	27	7	393	638	31	7	348	388
Total	209	209	3435	3435	35	35	2566	2566	38	38	2187	2187

* 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