

Fecha de Publicación: 11 de Mayo de 2009
Fecha de Información: 07 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\$813,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,8%.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	108,9	167,3	120,5	10,0	16,0	68,2	245,4
15-35	235,7	274,7	226,6	38,0	2,0	151,6	464,3
36-60	2,8	2,2	0,0	0,0	2,2	2,8	5,0
61-90	1,2	3,2	0,0	0,0	3,2	1,2	4,3
91-180	2,5	77,8	65,0	0,0	12,8	2,5	80,3
>180	9,0	13,9	0,0	0,0	4,9	0,0	14,0
Total	360,1	539,1	412,1	48,0	41,1	226,2	813,4

* 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	6,1 %	6,3 %	5,8 %	5,9 %
15-35	4,2 %	6,7 %	5,3 %	5,9 %
36-60	5,0 %	6,1 %	5,5 %	5,7 %
61-90	-	5,4 %	4,7 %	5,2 %
91-180	-	5,1 %	4,0 %	5,1 %
>180	4,6 %	4,9 %	3,6 %	4,7 %
Total	4,9 %	6,4 %	5,4 %	5,8 %

*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	4 al 8 de Mayo				11 al 15 de Mayo				18 al 22 de Mayo			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	5	43	1195	1415	18	25	1492	1775	5	33	1092	1532
Intragrupa y off-shore***	0	0	866	402	0	0	1266	698	0	0	980	381
Otros	43	5	431	675	25	18	352	637	33	5	323	482
Total	48	48	2492	2492	43	43	3110	3110	38	38	2395	2395

* 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