

Fecha de Publicación: 13 de Mayo de 2009
Fecha de Información: 11 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\$423,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,2%.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	54,9	25,0	5,0	16,0	19,8	38,7	79,7
15-35	114,4	244,4	145,2	36,0	54,2	33,4	313,9
36-60	4,6	0,7	0,0	0,0	0,7	4,6	5,3
61-90	2,5	0,7	0,0	1,4	0,7	1,1	3,2
91-180	0,8	7,0	0,0	0,0	7,0	0,8	7,7
>180	11,4	12,8	0,0	0,0	1,8	0,4	13,2
Total	188,6	290,6	150,2	53,4	84,2	79,0	423,0

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

*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

Sectores	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	1569	1802	5	33	1182	1563	5	28	674	691
Intragruppo y off-shore***	0	0	1271	748	0	0	997	425	0	0	366	95
Otros	25	20	364	654	33	5	336	527	28	5	197	450
Total	45	45	3204	3204	38	38	2516	2516	34	34	1236	1236

* 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