

Fecha de Publicación: 5 de Junio de 2009
Fecha de Información: 03 de Junio 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\$759,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	180,1	88,4	15,5	91,2	72,7	88,7	268,3
15-35	227,9	208,9	155,8	89,5	7,1	92,4	390,8
36-60	2,6	6,0	0,0	0,0	6,0	2,6	8,6
61-90	2,9	4,3	0,0	0,0	4,3	2,9	7,2
91-180	21,5	32,7	7,0	0,0	4,7	0,5	33,2
>180	5,1	51,2	44,0	0,0	2,2	0,1	51,3
Total	440,0	391,4	222,3	180,7	97,0	187,1	759,2

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

Sectores	1 al 5 de Junio				8 al 12 de Junio				15 al 19 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	27	1431	1378	9	27	1917	1656	13	27	878	1045
Intragruppo y off-shore***	0	2	880	552	0	1	1071	966	0	0	576	300
Otros	27	9	337	718	27	8	323	689	27	13	278	387
Total	38	38	2647	2647	36	36	3310	3310	41	41	1731	1731

* 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