

Fecha de Publicación: 6 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 04 de Agosto 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\$704,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,7%.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	137,4	149,8	60,0	21,1	75,4	101,9	272,8
15-35	183,2	133,3	115,9	84,0	11,4	93,2	310,5
36-60	60,9	37,5	0,0	22,0	37,5	38,9	98,4
61-90	0,6	6,7	0,0	0,0	6,7	0,6	7,3
91-180	1,3	8,5	0,0	0,0	8,5	1,3	9,8
>180	1,0	5,0	0,0	0,0	5,0	1,0	6,0
Total	384,4	340,8	175,9	127,1	144,5	236,8	704,8

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

*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	3 al 7 de Agosto				10 al 14 de Agosto				17 al 21 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	22	1825	1713	8	104	1699	1453	5	21	958	1050
Intragrupa y off-shore***	0	2	931	508	0	1	823	340	0	0	649	172
Otros	22	10	435	971	104	6	376	1105	21	5	250	635
Total	34	34	3192	3192	112	112	2898	2898	26	26	1857	1857

* 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