

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2009
Fecha de Información: 03 de Julio 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\$568,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,9%.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 | 141,3 | 283,5 | 190,0 | 30,0 | 13,4 | 31,2 | 344,7 |
| 15-35 | 80,1 | 53,2 | 43,0 | 20,0 | 10,2 | 60,1 | 133,3 |
| 36-60 | 47,0 | 49,5 | 0,0 | 0,0 | 14,5 | 12,0 | 61,5 |
| 61-90 | 15,1 | 23,5 | 6,0 | 0,0 | 2,5 | 0,1 | 23,6 |
| 91-180 | 0,0 | 3,4 | 0,0 | 0,0 | 3,4 | 0,0 | 3,4 |
| >180 | 0,0 | 1,6 | 0,0 | 0,0 | 1,6 | 0,0 | 1,6 |
| Total | 283,6 | 414,8 | 239,0 | 50,0 | 45,7 | 103,5 | 568,2 |

* 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 intragruppo | | Total |
|--------------|--------------------|-------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 2,7 % | 6,1 % | 4,3 % | 3,6 % |
| 15-35 | - | 6,0 % | 5,6 % | 5,7 % |
| 36-60 | 5,4 % | 6,5 % | 5,5 % | 5,7 % |
| 61-90 | 5,7 % | 6,1 % | 7,2 % | 5,8 % |
| 91-180 | - | 5,6 % | 3,2 % | 5,6 % |
| >180 | - | 5,7 % | - | 5,7 % |
| Total | 3,8 % | 6,1 % | 5,0 % | 4,9 % |

*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 | 29 de Jun. al 3 de Julio | | | | 6 al 10 de Julio | | | | 13 al 17 de Julio | | | |
|-----------------------------------|--------------------------|-----------|-------------|-------------|------------------|-----------|-------------|-------------|-------------------|-----------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 13 | 22 | 1748 | 1541 | 11 | 29 | 1739 | 1783 | 11 | 35 | 1285 | 1180 |
| Intragruppo y off-shore*** | 0 | 0 | 933 | 663 | 0 | 0 | 1132 | 580 | 0 | 0 | 643 | 299 |
| Otros | 22 | 13 | 336 | 813 | 29 | 11 | 291 | 799 | 35 | 11 | 345 | 794 |
| Total | 35 | 35 | 3016 | 3016 | 40 | 40 | 3163 | 3163 | 46 | 46 | 2273 | 2273 |

* 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 intragruppo