

Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2009
Fecha de Información: 09 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\$701,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 6,1%.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	99,7	265,8	224,0	0,0	31,8	89,7	355,5
15-35	195,3	140,9	69,5	49,5	39,4	113,8	304,2
36-60	20,1	1,0	0,0	0,0	1,0	20,1	21,0
61-90	0,2	0,8	0,0	0,0	0,8	0,1	1,0
91-180	0,4	1,1	0,0	0,0	1,1	0,4	1,5
>180	0,0	18,0	15,0	0,0	3,0	0,0	18,0
Total	315,5	427,7	308,5	49,5	77,1	224,0	701,1

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

*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	6 al 10 de Julio				13 al 17 de Julio				20 al 24 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	32	1824	1866	13	34	1863	1736	2	26	847	1126
Intragruppo y off-shore***	0	0	1162	580	0	0	902	444	0	0	805	239
Otros	32	11	343	883	34	13	541	1126	26	2	212	500
Total	43	43	3329	3329	47	47	3307	3307	28	28	1865	1865

* 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