

Fecha de Publicación: 14 de Julio de 2009
Fecha de Información: 10 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\$686,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,6%.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	158,0	187,1	93,0	20,0	46,1	90,0	297,2
15-35	130,3	189,2	76,0	39,0	52,9	31,0	259,1
36-60	2,9	26,1	10,0	0,0	16,1	2,9	29,0
61-90	31,1	3,6	0,0	0,0	2,9	30,3	33,9
91-180	43,3	23,7	0,0	0,0	23,7	43,3	66,9
>180	0,0	0,5	0,0	0,0	0,5	0,0	0,5
Total	365,5	430,1	179,0	59,0	142,1	197,5	686,6

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

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	27	1824	1866	13	32	1986	1892	2	26	883	1158
Intragrupa y off-shore***	0	0	1162	580	0	0	984	444	0	0	816	259
Otros	27	11	343	883	32	13	567	1201	26	2	234	516
Total	38	38	3329	3329	45	45	3537	3537	28	28	1933	1933

* 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