

Fecha de Publicación: 15 de Julio de 2009
 Fecha de Información: 13 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\$571,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,9%.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	94,0	87,4	17,6	36,5	69,6	57,3	181,2
15-35	199,9	117,9	71,8	38,7	29,1	144,2	300,8
36-60	37,3	12,9	0,0	0,0	12,8	37,3	50,2
61-90	3,0	11,1	4,0	0,0	7,1	3,0	14,1
91-180	0,2	21,7	15,0	0,0	6,7	0,2	21,9
>180	0,0	3,6	0,0	0,0	3,6	0,0	3,6
Total	334,4	254,5	108,4	75,2	128,9	242,0	571,7

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

*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

Sectores	13 al 17 de Julio				20 al 24 de Julio				27 al 31 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	30	2031	1946	2	28	906	1191	14	25	877	1070
Intragrupa y off-shore***	0	0	995	480	0	0	822	259	0	0	547	103
Otros	30	13	610	1210	28	2	260	538	25	14	318	569
Total	43	43	3636	3636	29	29	1988	1988	38	38	1742	1742

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo