

Fecha de Publicación: 16 de Julio de 2009
 Fecha de Información: 14 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\$577,3 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	143,8	79,7	0,0	35,0	34,7	63,7	178,5
15-35	258,5	148,5	37,0	80,0	26,5	93,5	321,9
36-60	14,0	11,5	0,0	0,0	11,5	14,0	25,5
61-90	0,5	4,6	0,0	0,0	4,6	0,5	5,1
91-180	11,8	32,4	15,0	0,0	7,4	1,8	34,2
>180	1,2	11,0	0,0	0,0	11,0	1,2	12,2
Total	429,7	287,6	52,0	115,0	95,6	174,7	577,3

* 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	6,1 %	6,6 %	5,5 %	5,8 %
15-35	6,2 %	6,4 %	5,6 %	5,9 %
36-60	-	6,1 %	5,7 %	5,9 %
61-90	-	6,1 %	5,2 %	6,0 %
91-180	5,7 %	6,0 %	5,2 %	5,8 %
>180	-	5,6 %	5,0 %	5,5 %
Total	6,1 %	6,3 %	5,6 %	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	32	2123	2012	2	28	948	1202	14	25	916	1082
Intragrupa y off-shore***	0	0	995	505	0	0	822	259	0	0	547	123
Otros	32	13	631	1231	28	2	272	580	25	14	330	588
Total	45	45	3748	3748	30	30	2041	2041	39	39	1793	1793

* 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