

Fecha de Publicación: 17 de Julio de 2009
Fecha de Información: 15 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\$711,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	278,2	58,9	13,7	203,6	45,0	74,4	337,0
15-35	168,7	69,5	42,0	71,4	10,5	80,3	221,1
36-60	36,7	4,8	0,0	0,0	4,7	36,7	41,4
61-90	0,9	3,9	0,0	0,0	3,9	0,9	4,8
91-180	0,9	71,4	55,0	0,0	16,4	0,9	72,4
>180	0,0	35,1	0,0	0,0	35,1	0,0	35,1
Total	485,4	243,6	110,8	275,0	115,6	193,2	711,8

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

*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	31	2323	2068	2	29	1024	1223	14	25	924	1129
Intragruppo y off-shore***	0	0	1050	705	0	0	822	277	0	0	571	108
Otros	31	13	632	1231	29	2	292	638	25	14	353	611
Total	44	44	4004	4004	31	31	2138	2138	40	40	1848	1848

* 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