

Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2009
Fecha de Información: 16 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\$779,4 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	167,8	60,8	13,0	40,0	37,7	117,7	218,5
15-35	244,3	304,4	224,0	40,1	22,7	146,5	491,0
36-60	36,1	2,8	0,0	0,0	2,8	36,1	38,9
61-90	1,0	2,9	0,0	0,0	2,9	1,0	3,9
91-180	10,6	20,6	2,0	0,0	8,2	0,2	20,8
>180	0,0	6,2	0,0	0,0	6,2	0,0	6,2
Total	459,8	397,9	239,0	80,1	80,6	301,5	779,4

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

Sector	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	31	1120	1256	15	26	1001	1155
Intragruppo y off-shore***	0	0	1050	705	0	0	823	317	0	0	583	108
Otros	30	13	632	1231	31	2	324	694	26	15	357	678
Total	43	43	4005	4005	34	34	2267	2267	41	41	1941	1941

* 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