

Fecha de Publicación: 22 de Julio de 2009
Fecha de Información: 17 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\$694,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.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	143,0	33,1	0,0	70,0	22,8	62,7	165,8
15-35	210,8	187,3	107,5	50,0	50,8	131,8	369,1
36-60	10,8	17,9	0,1	0,0	17,8	10,8	28,7
61-90	20,4	9,0	0,1	0,0	9,0	20,4	29,4
91-180	0,0	63,3	5,1	0,0	58,2	0,0	63,3
>180	30,6	7,7	0,0	0,0	7,7	30,6	38,3
Total	415,6	318,2	112,7	120,0	166,2	256,3	694,5

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

*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	30	2323	2068	3	32	1218	1282	15	27	1046	1161
Intragruppo y off-shore***	0	0	1050	705	0	0	823	387	0	0	583	108
Otros	30	13	632	1232	32	3	339	712	27	15	363	722
Total	43	43	4005	4005	35	35	2381	2381	42	42	1991	1991

* 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