

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 intragruppo | | 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 intragruppo