

Fecha de Publicación: 23 de Julio de 2009
Fecha de Información: 21 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\$896,2 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.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	368,2	72,9	14,8	158,0	38,0	190,1	421,0
15-35	164,0	288,6	211,0	15,0	29,1	100,5	404,1
36-60	1,5	4,3	0,0	0,0	4,3	1,5	5,8
61-90	3,5	11,1	0,0	0,0	11,1	3,5	14,6
91-180	20,1	14,1	0,0	0,0	14,1	20,1	34,1
>180	0,0	16,6	5,0	0,0	11,6	0,0	16,6
Total	557,3	407,5	230,8	173,0	108,1	315,7	896,2

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

*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	20 al 24 de Julio				27 al 31 de Julio				3 al 7 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	3	34	1322	1293	14	29	1265	1219	5	16	1015	1217
Intragruppo y off-shore***	0	0	826	453	0	0	592	198	0	0	720	158
Otros	34	3	348	749	29	14	391	832	16	5	231	590
Total	37	37	2496	2496	43	43	2249	2249	21	21	1966	1966

* 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