

Fecha de Publicación: 24 de Julio de 2009
Fecha de Información: 22 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\$666,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	256,4	67,9	0,0	87,0	42,1	143,6	298,5
15-35	233,5	103,7	57,8	67,0	25,3	145,9	316,5
36-60	2,6	5,1	0,0	0,0	5,1	2,6	7,7
61-90	1,1	14,7	10,0	0,0	4,2	0,6	15,3
91-180	0,3	10,2	0,0	0,0	10,1	0,3	10,4
>180	0,5	17,4	0,0	0,0	17,4	0,5	17,9
Total	494,4	218,9	67,8	154,0	104,2	293,5	666,4

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

Sectores	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	35	1378	1312	11	30	1386	1255	5	17	1101	1227
Intragrupa y off-shore***	0	0	826	488	0	0	592	203	0	0	720	205
Otros	35	3	347	751	30	11	422	942	17	5	241	630
Total	38	38	2551	2551	41	41	2400	2400	22	22	2062	2062

* 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