

Fecha de Publicación: 27 de Julio de 2009
Fecha de Información: 23 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\$1044,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,3%.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	194,4	204,7	147,0	98,0	57,1	95,7	398,4
15-35	282,6	267,8	190,8	57,0	41,0	189,6	514,4
36-60	26,1	4,1	0,0	10,0	4,1	16,1	30,2
61-90	2,3	32,9	28,0	0,0	4,9	2,3	35,1
91-180	7,2	27,8	20,0	5,0	7,8	2,1	35,0
>180	0,0	31,7	10,0	0,0	21,7	0,0	31,7
Total	512,6	569,0	395,8	170,0	136,5	305,9	1044,9

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

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	1316	12	30	1523	1440	6	18	1158	1241
Intragrupa y off-shore***	0	0	826	488	0	0	730	274	0	0	729	233
Otros	35	3	351	751	30	12	468	1008	18	6	246	659
Total	37	37	2555	2555	42	42	2722	2722	24	24	2133	2133

* 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