

Fecha de Publicación: 30 de Julio de 2009
Fecha de Información: 28 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\$712,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 5,7%.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	225,5	195,5	87,0	112,1	57,9	62,8	370,4
15-35	189,5	142,0	62,5	32,0	40,4	118,4	292,4
36-60	23,6	7,2	5,0	0,0	2,2	23,6	30,8
61-90	1,1	1,6	0,0	0,0	1,6	1,1	2,7
91-180	3,0	4,6	0,0	0,0	4,6	3,0	7,7
>180	3,4	5,4	0,0	0,0	5,4	3,4	8,8
Total	446,2	356,3	154,5	144,1	112,1	212,4	712,7

* 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	13,9 %	4,9 %	4,4 %	6,8 %
15-35	7,5 %	5,4 %	4,1 %	5,0 %
36-60	-	4,8 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	5,4 %	4,4 %	5,0 %
91-180	-	5,8 %	4,7 %	5,3 %
>180	-	5,7 %	4,7 %	5,3 %
Total	11,1 %	5,2 %	4,2 %	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

Sectores	27 al 31 de Julio				3 al 7 de Agosto				10 al 14 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	17	30	1856	1686	7	19	1378	1396	6	101	1306	1055
Intragrupa y off-shore***	0	6	907	454	0	0	749	318	0	0	590	325
Otros	30	12	527	1150	19	7	320	733	100	6	277	794
Total	47	47	3290	3290	26	26	2446	2446	106	106	2173	2173

* 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