

Fecha de Publicación: 31 de Julio de 2009
Fecha de Información: 29 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\$710,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,4%.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	143,2	123,1	60,6	36,0	42,5	87,2	246,3
15-35	217,8	184,5	88,5	82,8	66,5	105,6	372,8
36-60	20,4	3,2	0,0	6,0	3,2	14,4	23,6
61-90	4,5	21,9	20,0	0,0	1,9	4,5	26,4
91-180	15,6	9,8	0,0	0,0	9,8	15,6	25,5
>180	14,8	0,6	0,0	0,0	0,6	14,8	15,5
Total	416,5	343,1	169,1	124,8	124,5	242,2	710,1

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

*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	1869	1688	9	19	1483	1491	7	101	1335	1098
Intragruppo y off-shore***	0	6	907	465	0	0	795	343	0	0	615	325
Otros	30	12	529	1152	19	9	359	804	101	7	285	812
Total	47	47	3305	3305	28	28	2637	2637	108	108	2235	2235

* 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