

Fecha de Publicación: 3 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 30 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\$946,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,5%.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	244,1	108,5	65,0	138,5	43,2	105,4	352,3
15-35	201,4	278,0	246,5	32,0	17,5	155,4	465,4
36-60	10,9	85,8	81,0	0,0	4,8	10,9	96,7
61-90	1,4	1,3	0,0	0,0	1,3	1,4	2,7
91-180	1,0	18,8	10,0	0,0	8,8	1,0	19,8
>180	1,0	9,8	5,0	0,0	3,8	0,0	9,8
Total	459,9	502,0	407,5	170,5	79,2	274,1	946,6

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

*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

Sector	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**	19	29	1888	1691	10	19	1667	1577	7	102	1378	1121
Intragrupa y off-shore***	0	6	907	482	0	1	840	463	0	0	635	325
Otros	29	14	532	1154	19	9	400	867	102	7	287	855
Total	48	48	3327	3327	29	29	2907	2907	109	109	2301	2301

* 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