

Fecha de Publicación: 4 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 31 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\$694,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,1%.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	132,2	179,8	94,7	24,3	43,9	66,7	270,9
15-35	226,1	203,1	113,0	78,2	53,1	110,9	392,2
36-60	7,2	9,0	0,0	0,0	9,0	7,2	16,2
61-90	0,3	0,4	0,0	0,0	0,4	0,3	0,7
91-180	3,0	10,1	0,0	0,0	10,1	3,0	13,1
>180	1,0	0,1	0,0	0,0	0,1	1,0	1,1
Total	369,8	402,7	207,7	102,5	116,7	189,1	694,3

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

*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**	19	29	1888	1691	10	20	1704	1704	7	102	1473	1173
Intragrupa y off-shore***	0	6	907	482	0	1	931	487	0	0	639	325
Otros	29	14	532	1154	20	9	426	871	102	7	304	919
Total	49	49	3327	3327	30	30	3061	3061	109	109	2416	2416

* 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