

Fecha de Publicación: 11 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 06 de Agosto 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\$609,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,0%.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	70,0	179,0	126,0	5,3	42,7	54,4	238,6
15-35	208,5	101,5	27,0	15,0	28,5	147,5	264,0
36-60	47,9	20,9	0,0	10,0	20,9	37,9	68,8
61-90	6,1	1,4	0,0	0,0	1,4	6,1	7,5
91-180	1,8	16,6	10,0	0,0	6,6	1,8	18,5
>180	9,3	3,3	0,0	0,0	3,3	9,3	12,5
Total	343,5	322,7	163,0	30,3	103,3	256,9	609,9

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

*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	3 al 7 de Agosto				10 al 14 de Agosto				17 al 21 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	20	1827	1715	12	103	1881	1675	5	21	1000	1088
Intragrupa y off-shore***	0	2	931	508	0	2	959	367	0	0	649	177
Otros	20	9	438	973	102	10	432	1230	21	5	288	672
Total	31	31	3196	3196	114	114	3272	3272	26	26	1937	1937

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo