

Fecha de Publicación: 12 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 10 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\$587,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	86,7	191,5	103,2	1,1	78,0	75,2	267,8
15-35	152,9	123,8	61,5	32,8	44,3	102,1	258,7
36-60	21,6	4,9	0,0	0,0	4,9	21,6	26,5
61-90	3,1	0,5	0,0	0,0	0,5	3,1	3,7
91-180	17,9	3,8	0,0	0,0	3,8	17,9	21,7
>180	3,9	6,6	0,0	0,0	4,8	2,1	8,7
Total	286,1	331,2	164,7	33,9	136,4	222,0	587,1

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	4,1 %	1,0 %	3,4 %	2,1 %
15-35	5,1 %	4,3 %	3,9 %	4,2 %
36-60	-	5,0 %	4,1 %	4,3 %
61-90	-	5,1 %	4,2 %	4,3 %
91-180	-	5,4 %	3,6 %	3,9 %
>180	5,0 %	4,9 %	4,6 %	4,9 %
Total	4,7 %	2,8 %	3,8 %	3,4 %

*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	10 al 14 de Agosto				17 al 21 de Agosto				24 al 28 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	39	1907	1774	5	29	1057	1126	10	26	1244	1121
Intragrupo y off-shore***	0	2	1014	366	0	0	651	177	0	0	563	305
Otros	39	9	475	1257	29	5	314	719	26	10	279	660
Total	50	50	3396	3396	34	34	2022	2022	35	35	2086	2086

* 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