

Fecha de Publicación: 13 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 11 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\$527,3 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	97,3	103,5	42,0	3,0	61,2	93,9	200,5
15-35	102,3	206,9	143,4	51,4	62,8	50,2	308,5
36-60	1,6	0,5	0,0	0,0	0,5	1,6	2,1
61-90	3,3	2,1	0,0	0,0	2,1	3,3	5,5
91-180	0,6	0,9	0,0	0,0	0,9	0,6	1,5
>180	1,2	8,2	0,0	0,0	8,2	1,2	9,3
Total	206,3	322,1	185,4	54,4	135,6	150,9	527,3

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

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**	12	38	1957	1835	6	30	1081	1168	11	26	1285	1149
Intragrupa y off-shore***	0	2	1026	369	0	0	681	177	0	0	563	305
Otros	38	10	524	1303	30	6	325	743	26	11	307	701
Total	50	50	3507	3507	36	36	2088	2088	37	37	2155	2155

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo