

Fecha de Publicación: 14 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 12 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\$884,0 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	150,8	48,2	6,3	38,8	41,2	111,3	198,3
15-35	380,3	261,3	140,0	119,0	81,3	221,3	601,6
36-60	5,6	18,1	15,0	0,0	3,1	5,6	23,7
61-90	1,1	1,9	0,0	0,0	1,9	1,1	3,0
91-180	1,8	27,5	15,0	0,0	12,5	1,8	29,2
>180	11,0	27,1	0,0	0,0	17,1	1,0	28,1
Total	550,7	384,1	176,3	157,8	157,0	342,1	884,0

* 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 %	2,5 %	3,5 %	3,2 %
15-35	5,2 %	4,4 %	4,2 %	4,3 %
36-60	-	4,8 %	4,1 %	4,6 %
61-90	-	5,0 %	4,2 %	4,7 %
91-180	-	4,7 %	4,1 %	4,7 %
>180	4,7 %	4,7 %	4,5 %	4,7 %
Total	5,1 %	4,2 %	4,0 %	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	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	39	1993	1835	6	31	1188	1209	11	26	1326	1190
Intragrupa y off-shore***	0	2	1026	380	0	0	687	197	0	0	566	313
Otros	39	10	524	1329	31	6	360	829	26	11	345	733
Total	51	51	3543	3543	37	37	2235	2235	37	37	2236	2236

* 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