

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 13 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\$709,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	201,0	203,9	54,6	0,5	65,1	116,4	320,8
15-35	223,0	161,8	77,5	91,0	26,3	74,0	326,8
36-60	26,9	10,4	7,0	0,0	3,4	26,9	37,3
61-90	0,0	5,5	0,0	0,0	5,5	0,0	5,5
91-180	2,3	7,0	0,5	0,0	6,5	2,3	9,3
>180	5,0	4,3	0,0	0,0	4,3	5,0	9,3
Total	458,2	392,9	139,6	91,5	111,2	224,6	709,0

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

*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	41	2001	1835	6	32	1325	1347	11	26	1393	1262
Intragruppo y off-shore***	0	2	1026	380	0	0	727	198	0	0	580	313
Otros	40	10	524	1336	32	6	401	909	26	11	369	767
Total	53	53	3551	3551	38	38	2454	2454	37	37	2342	2342

* 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