

Fecha de Publicación: 20 de Agosto de 2009
 Fecha de Información: 18 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\$681,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	149,7	127,1	15,5	35,0	111,1	114,2	276,3
15-35	160,9	119,7	78,3	67,1	41,4	93,8	280,6
36-60	4,4	80,9	43,0	0,0	37,9	4,4	85,4
61-90	7,5	1,7	0,0	0,0	1,7	7,5	9,2
91-180	2,6	2,5	0,0	0,0	2,5	2,6	5,2
>180	6,5	18,9	12,5	0,0	6,4	6,5	25,3
Total	331,6	350,8	149,3	102,1	201,0	229,0	681,9

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

*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	17 al 21 de Agosto				24 al 28 de Agosto				31 de Ago. al 4 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	35	1540	1621	11	27	1560	1469	5	21	1148	1264
Intragrupa y off-shore***	7	0	836	214	0	0	596	329	0	0	660	250
Otros	27	6	498	1039	27	11	489	846	21	5	417	711
Total	41	41	2874	2874	38	38	2644	2644	26	26	2225	2225

* 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