

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2009
Fecha de Información: 21 de Agosto de 2009¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$830,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 4,7%.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	143,6	135,9	54,0	38,5	65,6	88,9	263,3
15-35	272,9	239,8	158,0	106,8	21,8	106,1	452,7
36-60	50,2	39,2	25,5	0,0	13,7	50,2	89,5
61-90	0,2	5,4	0,1	0,0	5,3	0,2	5,7
91-180	0,9	10,6	0,0	0,0	10,6	0,9	11,5
>180	0,0	7,5	0,0	0,0	7,5	0,0	7,5
Total	468,0	438,4	237,6	145,3	124,6	246,4	830,1

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

Sector	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	1603	1622	10	28	2065	1918	5	22	1232	1398
Intragruppo y off-shore***	7	0	892	271	0	1	866	593	0	0	787	333
Otros	28	6	443	1045	28	9	649	1069	21	5	394	681
Total	41	41	2938	2938	38	38	3580	3580	26	26	2412	2412

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo